

# ダイワファンドラップオンライン インデックス・シリーズ

ダイワファンドラップオンライン TOP I Xインデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

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)

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

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)

ダイワファンドラップオンライン J-R E I Tインデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国R E I Tインデックス (為替ヘッジあり)

ダイワファンドラップオンライン 外国R E I Tインデックス (為替ヘッジなし)

---

---

## 運用報告書 (全体版)

### 第 1 期

(決算日 2017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。

さて、「ダイワファンドラップオンライン インデックス・シリーズ」は、このたび、第1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

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)

T E L 0 1 2 0 - 1 0 6 2 1 2

(営業日の9:00~17:00)

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

# ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

★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                                                                                                                                                                                      |                            |
| 運用方針         | 投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。                                                                                                                                              |                            |
| 主要投資対象       | ベビーファンド                                                                                                                                                                                  | トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券  |
|              | トピックス・インデックス・マザーファンド                                                                                                                                                                     | 東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。） |
| マザーファンドの運用方法 | 投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。<br>イ. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。<br>ロ. ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。<br>ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。 |                            |
| 組入制限         | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率                                                                                                                                                                    | 無制限                        |
|              | ベビーファンドの株式実質組入上限比率                                                                                                                                                                       |                            |
|              | マザーファンドの株式組入上限比率                                                                                                                                                                         |                            |
| 分配方針         | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。                                                         |                            |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

## 運用報告書（全体版） 第1期 （決算日 2017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。

さて、「ダイワファンドラップオンラインTOPIXインデックス」は、このたび、第1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

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）

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

設定以来の運用実績

| 決 算 期             | 基 準 価 額     |         |           | T O P I X |           | 株 式 組 入 率<br>比 | 株 式 先 物 率<br>比 | 純 資 産 額<br>総 |
|-------------------|-------------|---------|-----------|-----------|-----------|----------------|----------------|--------------|
|                   |             | 税 込 配 金 | 期 中 騰 落 率 | (ベンチマーク)  | 期 中 騰 落 率 |                |                |              |
| 1 期末(2017年11月30日) | 円<br>11,827 | 円<br>0  | %<br>18.3 | 1,792.08  | %<br>16.2 | %<br>98.7      | %<br>1.3       | 百万円<br>1,308 |

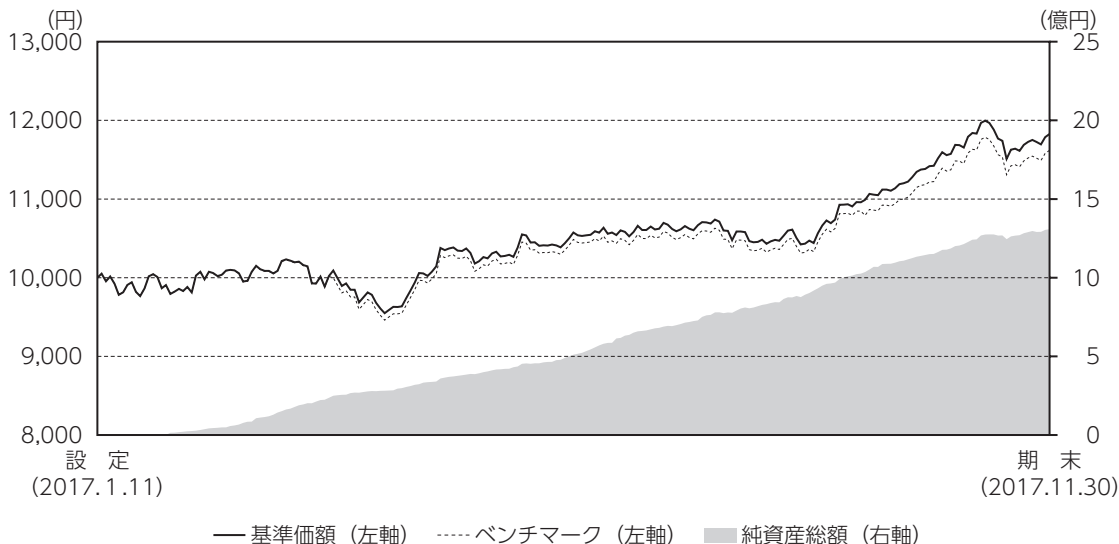
(注 1) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注 2) 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）ベンチマークは、設定時を10,000として指数化したものです。

\*ベンチマークはTOP I Xです。

#### ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：11,827円

騰落率：18.3%

#### ■基準価額の主な変動要因

衆議院議員選挙の結果を受けてTOP I Xが上昇したことなどを反映して、基準価額は上昇しました。TOP I Xの動向につきましては「投資環境について」をご参照ください。

| 年 月 日             | 基 準 価 額     | 騰 落 率  | T O P I X           |        | 株 式 組 入 率 | 株 式 先 物 率 |
|-------------------|-------------|--------|---------------------|--------|-----------|-----------|
|                   |             |        | (ベンチマーク)            | 騰 落 率  |           |           |
| (設定) 2017年 1 月11日 | 円<br>10,000 | %<br>－ | (1 /10)<br>1,542.31 | %<br>－ | %<br>－    | %<br>－    |
| 1 月末              | 9,866       | △ 1.3  | 1,521.67            | △ 1.3  | 99.4      | 0.5       |
| 2 月末              | 9,961       | △ 0.4  | 1,535.32            | △ 0.5  | 99.5      | 0.7       |
| 3 月末              | 9,895       | △ 1.1  | 1,512.60            | △ 1.9  | 97.4      | 2.5       |
| 4 月末              | 10,023      | 0.2    | 1,531.80            | △ 0.7  | 98.4      | 1.7       |
| 5 月末              | 10,265      | 2.7    | 1,568.37            | 1.7    | 98.6      | 1.3       |
| 6 月末              | 10,558      | 5.6    | 1,611.90            | 4.5    | 99.1      | 0.8       |
| 7 月末              | 10,603      | 6.0    | 1,618.61            | 4.9    | 99.1      | 0.8       |
| 8 月末              | 10,598      | 6.0    | 1,617.41            | 4.9    | 98.9      | 1.0       |
| 9 月末              | 11,056      | 10.6   | 1,674.75            | 8.6    | 98.7      | 1.2       |
| 10月末              | 11,654      | 16.5   | 1,765.96            | 14.5   | 98.3      | 1.7       |
| (期末) 2017年11月30日  | 11,827      | 18.3   | 1,792.08            | 16.2   | 98.7      | 1.3       |

(注) 騰落率は設定比。

## 投資環境について

(2017.1.11～2017.11.30)

### ■国内株式市況

国内株式市況は、設定時より、それまでの株価の急上昇に対する警戒感に加えて、トランプ米国大統領の政策に対する期待と不透明感が交錯し、一進一退で推移しました。2017年4月に入ると、北朝鮮の地政学リスクの高まりが懸念され、株価は下落しました。しかし4月後半からは、地政学リスク悪化の一巡に加えて、フランス大統領選挙で中道派のマクロン氏が極右政党の候補者を抑えて当選したことが好感され、株価は上昇しました。6月以降は、欧米の中央銀行の金融引き締めペースの見方が交錯し、株価は横ばい圏で推移しました。8月に入ると、再び北朝鮮に関わる地政学リスクが高まったことや、米国の物価統計の弱含みにより米国の2017年中の利上げ観測が後退したこと、対米ドルでの円高が進行したことなどが影響し、株価は軟調に推移しました。9月半ば以降は、米国の2017年中の利上げ観測が再び高まり円安米ドル高となったことや北朝鮮問題への懸念が一服したこと、10月に行なわれた衆議院議員選挙で連立与党が勝利したことなどを受け、株価は上昇しました。11月半ばには、急激な株価上昇への懸念から調整する場面が見られたものの、その後は、堅調な国内企業業績と米国の税制改革の進展が好感され、株価は上昇しました。

## ポートフォリオについて

(2017.1.11～2017.11.30)

### ■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ないました。

### ■トピックス・インデックス・マザーファンド

株式を中心に、一部TOPIX先物取引も利用し、株式組入比率（株式先物を含む。）につきましては、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TOPIXと同じように変動するよう、銘柄、株数を決定する体系的な手法）を用いて構築しています。

期中、資金変動への対応、新規上場等のTOPIXの構成の変化への対応のため、随時、株式の売買を行ないました。

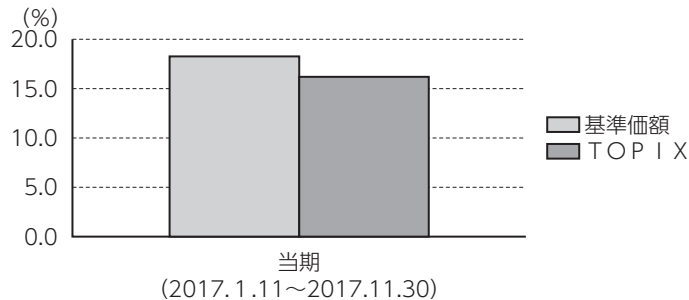
## ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（TOP I X）の騰落率は16.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は18.3%となりました。

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

その他、マザーファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの騰落率とTOP I Xの騰落率との差異、先物取引の影響、信託報酬等のコストがかい離の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。



## 分配金について

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

### 分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項 目        |     | 当 期                        |
|------------|-----|----------------------------|
|            |     | 2017年1月11日<br>～2017年11月30日 |
| 当期分配金（税込み） | (円) | —                          |
| 対基準価額比率    | (%) | —                          |
| 当期の収益      | (円) | —                          |
| 当期の収益以外    | (円) | —                          |
| 翌期繰越分配対象額  | (円) | 1,826                      |

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の受益証券の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（TOP I X）に連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。



1 万口当りの費用の明細

| 項 目       | 当期<br>(2017.1.11~2017.11.30) |         | 項 目 の 概 要                                                          |
|-----------|------------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------|
|           | 金 額                          | 比 率     |                                                                    |
| 信 託 報 酬   | 21円                          | 0.201%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は10,522円です。                       |
| (投 信 会 社) | (14)                         | (0.134) | 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、目<br>論見書・運用報告書の作成等の対価         |
| (販 売 会 社) | (5)                          | (0.048) | 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<br>の情報提供等の対価                |
| (受 託 銀 行) | (2)                          | (0.019) | 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   | 0                            | 0.001   | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株 式)     | (0)                          | (0.000) |                                                                    |
| (先 物)     | (0)                          | (0.001) |                                                                    |
| 有価証券取引税   | —                            | —       | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>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＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数                                          |
| (監 査 費 用) | (0)                          | (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       | 22                           | 0.207   |                                                                    |

(注 1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含まず。

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 比率欄は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

|                      | 設 定       |           | 解 約   |       |
|----------------------|-----------|-----------|-------|-------|
|                      | 口 数       | 金 額       | 口 数   | 金 額   |
|                      | 千口        | 千円        | 千口    | 千円    |
| トピックス・インデックス・マザーファンド | 1,182,026 | 1,169,040 | 6,459 | 6,823 |

(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

(2017年1月11日から2017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     | 17,613,704千円         |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 130,951,794千円        |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.13                 |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) トピックス・インデックス・マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

| 決 算 期   | 当 期       |                        |     |           |                        |     |
|---------|-----------|------------------------|-----|-----------|------------------------|-----|
|         | 買付額等<br>A | うち利害<br>関係人との<br>取引状況B | B／A | 売付額等<br>C | うち利害<br>関係人との<br>取引状況D | D／C |
|         | 百万円       | 百万円                    | %   | 百万円       | 百万円                    | %   |
| 株式      | 5,557     | －                      | －   | 12,056    | 370                    | 3.1 |
| 株式先物取引  | 15,615    | －                      | －   | 14,618    | －                      | －   |
| コール・ローン | 1,628,165 | －                      | －   | －         | －                      | －   |

(注) 平均保有割合0.5%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2017年1月11日から2017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     | 期末保有額      |
| 株式  | 百万円<br>1             | 百万円<br>43 | 百万円<br>323 |

(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

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

| 種 類 | 当 期                  |
|-----|----------------------|
|     | トピックス・インデックス・マザーファンド |
|     | 買 付 額                |
| 株式  | 百万円<br>27            |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 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

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

| 設定時保有額 | 期中設定額 | 期中解約額 | 期末保有額 | 取 引 の 理 由        |
|--------|-------|-------|-------|------------------|
| 百万円    | 百万円   | 百万円   | 百万円   |                  |
| 1      | －     | 1     | －     | 当初設定時における取得とその処分 |

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

| 種 類                  | 当 期 末     |           |
|----------------------|-----------|-----------|
|                      | 口 数       | 評 価 額     |
|                      | 千口        | 千円        |
| トピックス・インデックス・マザーファンド | 1,175,567 | 1,308,406 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

| 項 目                  | 当 期 末     |       |
|----------------------|-----------|-------|
|                      | 評 価 額     | 比 率   |
|                      | 千円        | %     |
| トピックス・インデックス・マザーファンド | 1,308,406 | 99.8  |
| コール・ローン等、その他         | 2,625     | 0.2   |
| 投資信託財産総額             | 1,311,032 | 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

2017年11月30日現在

| 項 目                       | 当 期 末          |
|---------------------------|----------------|
| (A) 資産                    | 1,311,032,544円 |
| コール・ローン等                  | 2,625,624      |
| トピックス・インデックス・マザーファンド(評価額) | 1,308,406,920  |
| (B) 負債                    | 2,542,028      |
| 未払解約金                     | 1,645,368      |
| 未払信託報酬                    | 875,875        |
| その他未払費用                   | 20,785         |
| (C) 純資産総額(A－B)            | 1,308,490,516  |
| 元本                        | 1,106,392,276  |
| 次期繰越損益金                   | 202,098,240    |
| (D) 受益権総口数                | 1,106,392,276口 |
| 1万口当り基準価額(C／D)            | 11,827円        |

\* 設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は1,207,147,382円、同解約元本額は101,755,106円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,827円です。

■損益の状況

当期 自2017年1月11日 至2017年11月30日

| 項 目              | 当 期           |
|------------------|---------------|
| (A) 配当等収益        | △ 427円        |
| 受取利息             | 10            |
| 支払利息             | △ 437         |
| (B) 有価証券売買損益     | 139,001,781   |
| 売買益              | 146,191,544   |
| 売買損              | △ 7,189,763   |
| (C) 信託報酬等        | △ 1,199,072   |
| (D) 当期損益金(A＋B＋C) | 137,802,282   |
| (E) 追加信託差損益金     | 64,295,958    |
| (配当等相当額)         | (△ 120)       |
| (売買損益相当額)        | ( 64,296,078) |
| (F) 合計(D＋E)      | 202,098,240   |
| 次期繰越損益金(F)       | 202,098,240   |
| 追加信託差損益金         | 64,295,958    |
| (配当等相当額)         | (△ 120)       |
| (売買損益相当額)        | ( 64,296,078) |
| 分配準備積立金          | 137,802,709   |
| 繰越損益金            | △ 427         |

(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「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■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  | 137,802,709    |
| (c) 収益調整金            | 64,296,078     |
| (d) 分配準備積立金          | 0              |
| (e) 当期分配対象額(a＋b＋c＋d) | 202,098,787    |
| (f) 分配金              | 0              |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e－f)   | 202,098,787    |
| (h) 受益権総口数           | 1,106,392,276口 |

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン TOP I Xインデックス）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2017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（2017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11～18ページに併せて掲載いたしました。

■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

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

| 買             |       |         |        | 付             |       |         |        | 売  |    |    |      | 付  |    |    |      |
|---------------|-------|---------|--------|---------------|-------|---------|--------|----|----|----|------|----|----|----|------|
| 銘柄            | 株数    | 金額      | 平均単価   | 銘柄            | 株数    | 金額      | 平均単価   | 銘柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 |
|               | 千株    | 千円      | 円      |               | 千株    | 千円      | 円      |    | 千株 | 千円 | 円    |    | 千株 | 千円 | 円    |
| 日本郵政          | 167.1 | 223,179 | 1,335  | 日本電信電話        | 64.8  | 346,946 | 5,354  |    |    |    |      |    |    |    |      |
| キーエンス         | 2.4   | 147,339 | 61,391 | 三菱UFJフィナンシャルG | 444.6 | 329,117 | 740    |    |    |    |      |    |    |    |      |
| リクルートホールディングス | 31.3  | 84,363  | 2,695  | 東芝            | 1,277 | 301,072 | 235    |    |    |    |      |    |    |    |      |
| 東海旅客鉄道        | 4.1   | 83,912  | 20,466 | KDDI          | 69.7  | 210,620 | 3,021  |    |    |    |      |    |    |    |      |
| トヨタ自動車        | 9     | 57,828  | 6,425  | トヨタ自動車        | 27.5  | 177,989 | 6,472  |    |    |    |      |    |    |    |      |
| 出光興産          | 19    | 57,064  | 3,003  | 三井住友フィナンシャルG  | 39.6  | 174,538 | 4,407  |    |    |    |      |    |    |    |      |
| 九州旅客鉄道        | 15.4  | 53,399  | 3,467  | ソニー           | 36    | 149,785 | 4,160  |    |    |    |      |    |    |    |      |
| ホシザキ          | 5.5   | 52,944  | 9,626  | 武田薬品          | 22.9  | 139,297 | 6,082  |    |    |    |      |    |    |    |      |
| フボタ           | 25    | 48,474  | 1,938  | ファナック         | 5.7   | 138,275 | 24,258 |    |    |    |      |    |    |    |      |
| 塩野義製薬         | 7.5   | 45,609  | 6,081  | 信越化学          | 11.2  | 121,722 | 10,868 |    |    |    |      |    |    |    |      |

(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、2017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（128,627,233千口）の内容です。

(1) 国内株式

| 銘柄            | 2017年11月30日現在 |         | 銘柄            | 2017年11月30日現在 |         | 銘柄         | 2017年11月30日現在 |         | 銘柄        | 2017年11月30日現在 |         |
|---------------|---------------|---------|---------------|---------------|---------|------------|---------------|---------|-----------|---------------|---------|
|               | 株数            | 評価額     |               | 株数            | 評価額     |            | 株数            | 評価額     |           | 株数            | 評価額     |
|               | 千株            | 千円      |               | 千株            | 千円      |            | 千株            | 千円      |           | 千株            | 千円      |
| 水産・農林業 (0.1%) |               |         | 東急建設          | 24.3          | 26,365  | 東鉄工業       | 7.3           | 26,827  | 福田組       | 2.3           | 15,801  |
| 極洋            | 3.8           | 14,630  | コムシスホールディングス  | 21.3          | 66,775  | 浅沼組        | 26            | 10,322  | 住友林業      | 39.1          | 75,463  |
| 日本水産          | 70.1          | 43,041  | ミサワホーム        | 7.5           | 7,455   | 戸田建設       | 72            | 64,512  | 日本基礎技術    | 19            | 7,999   |
| マルハニチロ        | 11.7          | 37,791  | 髙松コンストラクショングP | 4             | 11,584  | 熊谷組        | 9.7           | 30,312  | 日成ビルド工業   | 10            | 13,710  |
| カネコ種苗         | 5.4           | 9,088   | 東建コーポレーション    | 2.4           | 33,816  | 北野建設       | 19            | 7,809   | 巴コーポレーション | 21.9          | 13,315  |
| サカタのタネ        | 9.3           | 34,549  | ヤマウラ          | 8.3           | 7,279   | 三井ホーム      | 11            | 7,513   | 大和ハウス     | 183           | 752,862 |
| ホクト           | 6.5           | 13,117  | 大成建設          | 63.1          | 372,290 | 矢作建設       | 10.2          | 10,118  | ライト工業     | 11.8          | 14,726  |
| 鉱業 (0.3%)     |               |         | 大林組           | 185.7         | 269,636 | ピーエス三菱     | 10.9          | 9,635   | 積水ハウス     | 200.5         | 419,947 |
| 日鉄鉱業          | 1.8           | 13,806  | 清水建設          | 190.1         | 237,054 | 日本ハウスHLDGS | 15.1          | 9,407   | 日特建設      | 10.3          | 6,931   |
| 三井松島          | 5             | 6,965   | 飛鳥建設          | 74.8          | 12,117  | 大東建託       | 22.4          | 460,208 | ユアテック     | 9.9           | 9,692   |
| 国際石油開発帝石      | 297.9         | 376,843 | 長谷工コーポレーション   | 72            | 125,496 | 新日本建設      | 8.5           | 7,973   | 中電工       | 7.7           | 24,832  |
| 日本海洋掘削        | 3.5           | 8,228   | 松井建設          | 8.7           | 8,282   | NIPPPO     | 13            | 34,541  | 関電工       | 23.9          | 26,409  |
| 石油資源開発        | 8.6           | 22,127  | 鹿島建設          | 272           | 320,688 | 東亜道路       | 1.7           | 7,828   | きんでん      | 41.1          | 78,624  |
| K&Oエナジーグループ   | 4             | 7,792   | 不動テトラ         | 55            | 10,120  | 前田道路       | 18            | 45,594  | 東京エネシス    | 7.6           | 9,918   |
| 建設業 (3.3%)    |               |         | 鉄建建設          | 3.9           | 13,104  | 日本道路       | 1.7           | 11,475  | トーエネック    | 1.9           | 6,175   |
| ショーボンドHD      | 5.8           | 41,296  | 西松建設          | 14            | 45,570  | 東亜建設       | 5.4           | 16,524  | 住友電設      | 5             | 12,160  |
| ミライト・ホールディングス | 18.9          | 28,406  | 三井住友建設        | 45.2          | 28,928  | 若築建設       | 4.7           | 8,234   | 日本電設工業    | 9.4           | 22,014  |
| タマホーム         | 10.3          | 7,313   | 大豊建設          | 24            | 13,920  | 東洋建設       | 19.9          | 12,457  | 協和エクシオ    | 21.9          | 59,086  |
| インベスターズクラウド   | 1.2           | 7,992   | 前田建設          | 44            | 72,644  | 五洋建設       | 72.6          | 60,766  | 九電工       | 12.2          | 64,904  |
| 安藤・間          | 47.9          | 42,487  | 奥村組           | 9.6           | 43,824  | 世紀東急       | 12.6          | 7,610   | 三機工業      | 13.1          | 18,156  |

| 銘柄              | 株数    | 千株      | 千円 | 評価額 | 銘柄            | 株数    | 千株        | 千円 | 評価額 | 銘柄          | 株数    | 千株        | 千円 | 評価額 | 銘柄              | 株数    | 千株        | 千円 | 評価額 |
|-----------------|-------|---------|----|-----|---------------|-------|-----------|----|-----|-------------|-------|-----------|----|-----|-----------------|-------|-----------|----|-----|
| 日揮              | 52.8  | 103,012 |    |     | キッコーマン        | 43.6  | 191,840   |    |     | ザ・バック       | 4.2   | 15,834    |    |     | リケンテクノス         | 14.3  | 9,009     |    |     |
| 中外炉工業           | 3.7   | 8,073   |    |     | 味の素           | 127.6 | 263,366   |    |     | 化学 (7.3%)   |       |           |    |     | 大倉工業            | 15    | 10,185    |    |     |
| 太平電業            | 4.2   | 11,125  |    |     | キューピー         | 31.5  | 90,877    |    |     | クラレ         | 96.6  | 208,752   |    |     | 積水化成品           | 8     | 11,336    |    |     |
| 高砂熱学            | 17    | 35,564  |    |     | ハウス食品G本社      | 21.4  | 78,324    |    |     | 旭化成         | 360.5 | 506,502   |    |     | 群栄化学            | 2.1   | 7,864     |    |     |
| 明星工業            | 12.6  | 10,155  |    |     | カゴメ           | 22.4  | 93,296    |    |     | 共和レザー       | 7.3   | 7,212     |    |     | ダイキョーニシカワ       | 11.6  | 21,819    |    |     |
| 大氣社             | 7.9   | 29,783  |    |     | アリアケジャパン      | 5.1   | 51,918    |    |     | 昭和電工        | 38.6  | 160,769   |    |     | 竹本容器            | 3.5   | 7,500     |    |     |
| ダイダン            | 4.5   | 13,837  |    |     | ニチレイ          | 26.5  | 86,390    |    |     | 住友化学        | 425   | 332,350   |    |     | 日本化薬            | 36.9  | 62,803    |    |     |
| 日比谷総合設備         | 7.1   | 17,529  |    |     | 東洋水産          | 30.2  | 144,356   |    |     | 住友精化        | 2.4   | 15,528    |    |     | カーリットホールディングス   | 15.2  | 16,720    |    |     |
| 東芝プラントシステム      | 13.3  | 28,289  |    |     | 日清食品HD        | 24.1  | 195,451   |    |     | 日産化学        | 33.5  | 150,750   |    |     | 日本精化            | 9.2   | 10,350    |    |     |
| OSJBHD          | 31.3  | 10,297  |    |     | 永谷園ホールディングス   | 8     | 11,112    |    |     | ラサ工業        | 4     | 9,208     |    |     | 扶桑化学工業          | 4.2   | 14,112    |    |     |
| 東洋エンジニア         | 7.7   | 9,794   |    |     | フジッコ          | 6.2   | 15,741    |    |     | クレハ         | 4.7   | 34,780    |    |     | ADEKA           | 23.8  | 45,124    |    |     |
| 千代田化工建          | 38.9  | 28,630  |    |     | ロックフィールド      | 6.8   | 14,096    |    |     | テイカ         | 4.9   | 14,401    |    |     | 日油              | 22    | 67,980    |    |     |
| 新興プラントック        | 13    | 14,781  |    |     | 日本たばこ産業       | 343   | 1,275,960 |    |     | 石原産業        | 10.6  | 21,687    |    |     | ハリマ化成グループ       | 6.6   | 5,735     |    |     |
| 食料品 (4.5%)      |       |         |    |     | ケンコーマヨネーズ     | 4.2   | 14,385    |    |     | 日本曹達        | 39    | 29,094    |    |     | 花王              | 135.9 | 1,010,824 |    |     |
| 日本製粉            | 17.8  | 29,494  |    |     | わらべや日洋HD      | 3.9   | 11,680    |    |     | 東ソー         | 83.5  | 206,996   |    |     | 第一工業製薬          | 14    | 11,368    |    |     |
| 日清製粉G本社         | 67.3  | 147,790 |    |     | ユーグレナ         | 22    | 24,464    |    |     | トクヤマ        | 16.8  | 57,708    |    |     | 三洋化成            | 3.4   | 20,128    |    |     |
| 昭和産業            | 5.1   | 14,682  |    |     | 理研ビタミン        | 2.3   | 10,304    |    |     | セントラル硝子     | 11.4  | 28,443    |    |     | 大日本塗料           | 6.9   | 12,978    |    |     |
| 中部飼料            | 7.2   | 16,308  |    |     | 繊維製品 (0.7%)   |       |           |    |     | 東亜合成        | 32.7  | 47,186    |    |     | 日本ペイントHOLD      | 44.7  | 154,215   |    |     |
| フィード・ワン         | 42.9  | 12,269  |    |     | 片倉工業          | 7.9   | 10,309    |    |     | 大阪ソーダ       | 5.3   | 15,163    |    |     | 関西ペイント          | 60.9  | 179,594   |    |     |
| 東洋精糖            | 8.6   | 10,371  |    |     | グンゼ           | 4.4   | 25,872    |    |     | 関東電化        | 14    | 17,850    |    |     | 中国塗料            | 17.4  | 16,860    |    |     |
| 三井製糖            | 4.5   | 20,700  |    |     | 東洋紡           | 21.2  | 43,396    |    |     | デンカ         | 21    | 86,730    |    |     | 日本特殊塗料          | 4.2   | 9,580     |    |     |
| 塩水港精糖           | 32.1  | 8,538   |    |     | ユニチカ          | 17.8  | 14,880    |    |     | 信越化学        | 96.4  | 1,134,146 |    |     | 藤倉化成            | 12.4  | 8,568     |    |     |
| 日新製糖            | 3.4   | 7,248   |    |     | 富士紡ホールディングス   | 3.5   | 12,197    |    |     | 日本カーバイド     | 2.9   | 6,005     |    |     | 太陽ホールディングス      | 4.4   | 22,616    |    |     |
| 森永製菓            | 13.1  | 73,753  |    |     | 倉敷紡績          | 59    | 20,237    |    |     | 堺化学         | 3.9   | 9,874     |    |     | DIC             | 22.5  | 93,937    |    |     |
| 江崎グリコ           | 15.5  | 86,025  |    |     | シキボウ          | 5.5   | 7,766     |    |     | エア・ウォーター    | 46.7  | 112,453   |    |     | サカタインクス         | 12    | 23,340    |    |     |
| 不二家             | 4.3   | 11,124  |    |     | 日本毛織          | 15.9  | 15,772    |    |     | 大陽日酸        | 44.2  | 68,112    |    |     | 東洋インキSCホールディングス | 53    | 34,450    |    |     |
| 山崎製パン           | 45.1  | 97,686  |    |     | 帝国繊維          | 6.6   | 14,638    |    |     | 日本化学工業      | 3.4   | 8,615     |    |     | T&K TOKA        | 5.5   | 7,403     |    |     |
| モロゾフ            | 1.5   | 11,205  |    |     | 日本ペーパー        | 46.5  | 112,530   |    |     | 日本パーカライジング  | 28.7  | 53,410    |    |     | 富士フイルムHLDGS     | 114.6 | 525,097   |    |     |
| 亀田製菓            | 3.6   | 19,260  |    |     | 東レ            | 419.6 | 443,517   |    |     | 高圧ガス        | 10.6  | 10,038    |    |     | 資生堂             | 103.2 | 564,710   |    |     |
| 寿スピリッツ          | 5.6   | 30,352  |    |     | サカイ オーベックス    | 3.1   | 8,091     |    |     | 四国化成        | 8.9   | 16,384    |    |     | ライオン            | 77    | 161,238   |    |     |
| カルビー            | 25.3  | 99,302  |    |     | 住江織物          | 2.1   | 6,457     |    |     | 戸田工業        | 1.5   | 6,345     |    |     | 高砂香料            | 3.5   | 12,407    |    |     |
| 森永乳業            | 11.2  | 51,408  |    |     | アツギ           | 8.3   | 10,673    |    |     | ステラ ケミファ    | 3     | 11,190    |    |     | マンダム            | 10.5  | 39,847    |    |     |
| 六甲バター           | 3.4   | 9,248   |    |     | ダイニツク         | 7.1   | 8,441     |    |     | 保土谷化学       | 1.9   | 12,559    |    |     | ミルボン            | 3.8   | 30,742    |    |     |
| ヤクルト            | 33.3  | 291,708 |    |     | セーレン          | 13.3  | 27,969    |    |     | 日本触媒        | 9     | 70,470    |    |     | ファンケル           | 13.7  | 44,045    |    |     |
| 明治ホールディングス      | 36.7  | 358,926 |    |     | ソトー           | 9.6   | 10,809    |    |     | 大日精化        | 4.4   | 23,672    |    |     | コーセー            | 9.4   | 161,868   |    |     |
| 雪印メグミルク         | 13.5  | 42,120  |    |     | 東海染工          | 5.5   | 7,854     |    |     | カネカ         | 76    | 75,392    |    |     | シーズ・ホールディングス    | 7.8   | 36,777    |    |     |
| プリマハム           | 39    | 30,459  |    |     | 小松精練          | 11.3  | 10,181    |    |     | 三菱瓦斯化学      | 49.4  | 155,116   |    |     | ポーラ・オルビスHD      | 23.9  | 97,990    |    |     |
| 日本ハム            | 48    | 132,336 |    |     | ワコールホールディングス  | 15.5  | 53,940    |    |     | 三井化学        | 52    | 188,500   |    |     | ノビアホールディングス     | 3.8   | 30,362    |    |     |
| 丸大食品            | 32    | 15,872  |    |     | ホギメディカル       | 3.6   | 29,124    |    |     | JSR         | 57.5  | 123,682   |    |     | エステー            | 4.7   | 14,076    |    |     |
| S Foods         | 3.9   | 18,837  |    |     | TSIホールディングス   | 22.3  | 18,999    |    |     | 東京応化工業      | 10    | 47,050    |    |     | コニシ             | 9.3   | 18,906    |    |     |
| 伊藤ハム米久HLDGS     | 35.8  | 36,372  |    |     | 三陽商会          | 4.9   | 10,353    |    |     | 大阪有機化学      | 4.9   | 6,472     |    |     | 長谷川香料           | 7.6   | 17,373    |    |     |
| サッポロホールディングス    | 20.5  | 72,057  |    |     | オンワードホールディングス | 3.5   | 32,060    |    |     | 三菱ケミカルHLDGS | 387.3 | 470,956   |    |     | 小林製薬            | 15.2  | 107,768   |    |     |
| アサヒグループホールディングス | 116.7 | 666,006 |    |     | ゴールデンウイン      | 1.8   | 14,760    |    |     | KHネオケム      | 8.9   | 23,887    |    |     | 荒川化学工業          | 5.4   | 13,251    |    |     |
| キリンHD           | 266.7 | 701,287 |    |     | デサント          | 13    | 21,528    |    |     | ダイセル        | 76.9  | 102,353   |    |     | メック             | 4.5   | 10,863    |    |     |
| 宝ホールディングス       | 45.5  | 57,193  |    |     | パルプ・紙 (0.3%)  |       |           |    |     | 住友ベークライト    | 46    | 42,136    |    |     | 日本高純度化学         | 4.1   | 10,893    |    |     |
| オエノンホールディングス    | 31.1  | 11,040  |    |     | 特種東海製紙        | 3.4   | 13,668    |    |     | 積水化学        | 119.7 | 259,868   |    |     | タカラバイオ          | 14.4  | 21,484    |    |     |
| コカ・コーラボラータースJ   | 39.2  | 167,188 |    |     | 王子ホールディングス    | 238   | 162,554   |    |     | 日本ゼオン       | 48.5  | 75,320    |    |     | JCIU            | 3.5   | 20,020    |    |     |
| サントリー食品インター     | 42.6  | 207,036 |    |     | 日本製紙          | 24.4  | 52,557    |    |     | アイカ工業       | 15.8  | 62,173    |    |     | 新田ゼラチン          | 10.3  | 7,951     |    |     |
| グアテグループHD       | 2.9   | 16,791  |    |     | 三菱製紙          | 13.1  | 9,274     |    |     | 宇部興産        | 28.8  | 93,744    |    |     | デクセリアルズ         | 14.2  | 19,368    |    |     |
| 伊藤園             | 18.4  | 76,912  |    |     | 北越紀州製紙        | 31.3  | 19,719    |    |     | 積水樹脂        | 9     | 20,763    |    |     | アース製薬           | 4.2   | 24,318    |    |     |
| キーコーヒー          | 6.8   | 14,599  |    |     | 中越パルプ         | 3.4   | 7,061     |    |     | タキロンシーアイ    | 14    | 11,396    |    |     | 北興化学            | 10    | 7,180     |    |     |
| 日清オイリオグループ      | 6.6   | 22,803  |    |     | 大王製紙          | 22.9  | 34,372    |    |     | 旭有機材        | 5.6   | 10,298    |    |     | クミアイ化学          | 24.9  | 19,422    |    |     |
| 不二製油グループ        | 15.1  | 49,301  |    |     | レンゴー          | 53.2  | 38,782    |    |     | 日立化成        | 28.1  | 82,979    |    |     | 日本農薬            | 15    | 10,395    |    |     |
| J-オイルミルズ        | 3.2   | 12,896  |    |     | トーモク          | 4.2   | 8,853     |    |     | ニチパン        | 3.4   | 10,074    |    |     | アキレス            | 5.3   | 12,857    |    |     |

## トピックス・インデックス・マザーファンド

| 銘柄                    | 株数    | 千円        | 2017年11月30日現在<br>評価額 | 銘柄                     | 株数    | 千円      | 2017年11月30日現在<br>評価額 | 銘柄                 | 株数    | 千円      | 2017年11月30日現在<br>評価額 | 銘柄               | 株数    | 千円      | 2017年11月30日現在<br>評価額 |
|-----------------------|-------|-----------|----------------------|------------------------|-------|---------|----------------------|--------------------|-------|---------|----------------------|------------------|-------|---------|----------------------|
| 有沢製作所                 | 11.2  | 14,112    |                      | ビーピー・カストロール            | 3.1   | 6,745   |                      | 淀川製鋼所              | 8     | 26,720  |                      | リンナイ             | 9.7   | 97,679  |                      |
| 日東電工                  | 41.7  | 459,951   |                      | 富士石油                   | 15.5  | 8,525   |                      | 東洋鋼板               | 14.9  | 6,824   |                      | 岡部               | 11.7  | 12,320  |                      |
| レック                   | 3.6   | 9,806     |                      | MORESCO                | 3.7   | 7,703   |                      | 丸一鋼管               | 19    | 60,230  |                      | ジーテクト            | 6.2   | 14,669  |                      |
| 藤森工業                  | 4.8   | 18,984    |                      | 出光興産                   | 46    | 173,420 |                      | 大同特殊鋼              | 9.6   | 65,184  |                      | 東プレ              | 9.8   | 31,556  |                      |
| ジェイエスピー               | 3.5   | 13,247    |                      | JXTGホールディングス           | 876   | 551,880 |                      | 日本高周波              | 5.7   | 5,232   |                      | 高周波熱錬            | 11.2  | 13,104  |                      |
| エフピコ                  | 4.6   | 28,658    |                      | コスモエネルギーHD             | 15.7  | 52,987  |                      | 日本冶金工              | 49.9  | 11,077  |                      | 東京製鋼             | 5     | 8,030   |                      |
| 天馬                    | 4.5   | 9,472     |                      | <b>ゴム製品 (1.0%)</b>     |       |         |                      | 山陽特殊製鋼             | 6.3   | 17,955  |                      | パイオラックス          | 8.4   | 28,812  |                      |
| 信越ポリマー                | 11.4  | 13,497    |                      | 横浜ゴム                   | 31.7  | 79,757  |                      | 愛知製鋼               | 2.8   | 12,306  |                      | エイチワン            | 4     | 6,380   |                      |
| 東リ                    | 22.3  | 9,053     |                      | 東洋ゴム                   | 32.7  | 74,883  |                      | 日立金属               | 58.3  | 86,575  |                      | 日本発条             | 53    | 66,250  |                      |
| ニフコ                   | 10    | 75,300    |                      | ブリヂストン                 | 195.3 | 995,053 |                      | 日本金属               | 1.9   | 4,824   |                      | 立川プラインド          | 5.2   | 7,212   |                      |
| 日本バルカー                | 4.9   | 12,980    |                      | 住友ゴム                   | 53.6  | 109,344 |                      | 大平洋金属              | 3.7   | 10,866  |                      | 三益半導体            | 5.4   | 11,178  |                      |
| ユニ・チャーム               | 117   | 344,331   |                      | 藤倉ゴム                   | 7.5   | 7,597   |                      | 新日本電工              | 34.2  | 15,184  |                      | <b>機械 (5.5%)</b> |       |         |                      |
| <b>医薬品 (4.4%)</b>     |       |           |                      | オカモト                   | 20    | 22,840  |                      | 栗本鉄工所              | 3.6   | 8,251   |                      | 日本製鋼所            | 18.1  | 65,160  |                      |
| 協和発酵キリン               | 69.2  | 147,326   |                      | ニッタ                    | 5.7   | 25,051  |                      | 三菱製鋼               | 3.8   | 10,256  |                      | 三浦工業             | 23.7  | 68,066  |                      |
| 武田薬品                  | 203.4 | 1,257,825 |                      | 住友理工                   | 10.2  | 12,046  |                      | 日本精線               | 1.4   | 7,742   |                      | タクマ              | 18.7  | 30,499  |                      |
| アステラス製薬               | 567.4 | 809,112   |                      | 三ツ星ベルト                 | 13    | 19,032  |                      | シンニッタン             | 9.7   | 7,352   |                      | ツガミ              | 15    | 15,535  |                      |
| 大日本住友製薬               | 40.8  | 66,422    |                      | バンドー化学                 | 10.7  | 13,621  |                      | <b>非鉄金属 (1.0%)</b> |       |         |                      | オークマ             | 6.2   | 44,392  |                      |
| 塩野義製薬                 | 79    | 494,461   |                      | <b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b> |       |         |                      | 大紀アルミニウム           | 10.4  | 8,268   |                      | 東芝機械             | 31    | 24,583  |                      |
| 田辺三菱製薬                | 67.1  | 162,851   |                      | 日東紡績                   | 8.3   | 27,971  |                      | 日本軽金属HD            | 156.1 | 46,830  |                      | アマダホールディングス      | 82.9  | 123,603 |                      |
| あすか製薬                 | 6.7   | 13,694    |                      | 旭硝子                    | 56.2  | 263,016 |                      | 三井金属               | 14.7  | 93,198  |                      | アイダエンジニア         | 13.6  | 18,564  |                      |
| 日本新薬                  | 14.5  | 116,580   |                      | 日本板硝子                  | 27.3  | 27,108  |                      | 東邦亜鉛               | 3.2   | 18,496  |                      | 滝澤鉄工所            | 4.7   | 9,987   |                      |
| 中外製薬                  | 58    | 336,980   |                      | 日本山村硝子                 | 52    | 9,828   |                      | 三菱マテリアル            | 35.8  | 134,250 |                      | 富士機械製造           | 16.1  | 35,210  |                      |
| 科研製薬                  | 9.8   | 55,076    |                      | 日本電気硝子                 | 23.8  | 103,768 |                      | 住友鉱山               | 70.1  | 305,285 |                      | 牧野フリス            | 25    | 27,825  |                      |
| エーザイ                  | 66.2  | 421,760   |                      | 住友大阪セメント               | 107   | 56,282  |                      | DOWAホールディングス       | 13.8  | 58,926  |                      | オーエスジー           | 23.9  | 54,874  |                      |
| ロート製薬                 | 30.5  | 87,809    |                      | 太平洋セメント                | 34.8  | 160,428 |                      | 古河機金               | 9     | 20,358  |                      | 旭ダイヤモンド          | 16.7  | 20,223  |                      |
| 小野薬品                  | 141.7 | 362,610   |                      | 日本ヒューム                 | 11.8  | 9,192   |                      | 大阪チタニウム            | 6.3   | 11,718  |                      | DMG森精機           | 29.8  | 66,960  |                      |
| 久光製薬                  | 16.3  | 103,016   |                      | 日本コンクリート               | 16.6  | 8,349   |                      | 東邦チタニウム            | 10.8  | 10,962  |                      | ソディック            | 12.2  | 18,080  |                      |
| 持田製薬                  | 3.8   | 30,856    |                      | アジアパイルHD               | 10.7  | 8,688   |                      | UACJ               | 8.2   | 23,862  |                      | デイスコ             | 7.4   | 183,964 |                      |
| 参天製薬                  | 104.7 | 179,246   |                      | 東海カーボン                 | 51.1  | 60,655  |                      | 古河電工               | 18.2  | 108,108 |                      | 日東工器             | 4     | 11,344  |                      |
| 扶桑薬品                  | 3.7   | 10,441    |                      | 日本カーボン                 | 3.1   | 13,593  |                      | 住友電工               | 203.7 | 398,946 |                      | パンチ工業            | 3.2   | 7,827   |                      |
| 日本ケミファ                | 1.6   | 7,960     |                      | 東洋炭素                   | 4     | 14,360  |                      | フジクラ               | 64.8  | 67,845  |                      | 豊和工業             | 3.5   | 5,425   |                      |
| ツムラ                   | 19.8  | 76,824    |                      | ノリタケ                   | 3.3   | 17,061  |                      | 昭和電線HLDGS          | 8.5   | 8,483   |                      | OKK              | 5.1   | 6,420   |                      |
| 日医工                   | 14.3  | 24,138    |                      | TOTO                   | 42.5  | 265,200 |                      | タツタ電線              | 11.5  | 9,798   |                      | 石川製作所            | 1.7   | 4,981   |                      |
| キッセイ薬品工業              | 10.1  | 32,370    |                      | 日本碍子                   | 66.4  | 142,428 |                      | リョービ               | 6.7   | 19,470  |                      | 東洋機械金属           | 7     | 6,048   |                      |
| 生化学工業                 | 11    | 17,897    |                      | 日本特殊陶業                 | 47    | 121,542 |                      | アーレステイ             | 8.6   | 7,920   |                      | 島精機製作所           | 7     | 50,540  |                      |
| 栄研化学                  | 4.5   | 23,175    |                      | MA RUWA                | 2     | 14,240  |                      | アサヒHD              | 9.3   | 18,423  |                      | ヤマシンフィルタ         | 8.5   | 11,687  |                      |
| 鳥居薬品                  | 3.7   | 10,963    |                      | 品川リフラクトリーズ             | 2     | 6,780   |                      | <b>金属製品 (0.7%)</b> |       |         |                      | 日阪製作所            | 10.3  | 12,164  |                      |
| JCRファーマ               | 4.1   | 19,106    |                      | 黒崎播磨                   | 1.3   | 6,032   |                      | 宮地エンジニアリング         | 2.2   | 5,768   |                      | やまびこ             | 10.6  | 17,956  |                      |
| 東和薬品                  | 2.7   | 15,741    |                      | ニッカト                   | 11.7  | 11,079  |                      | トーカロ               | 3.9   | 18,544  |                      | 平田機工             | 1.6   | 19,792  |                      |
| 富士製薬工業                | 2.1   | 9,124     |                      | フジミンコーポレートッド           | 5.1   | 13,071  |                      | アルファCO             | 2.6   | 5,977   |                      | ナブテスコ            | 29.8  | 130,673 |                      |
| 沢井製薬                  | 9.6   | 52,704    |                      | ニチアス                   | 30    | 43,350  |                      | SUMCO              | 50.6  | 142,843 |                      | 三井海洋開発           | 5.5   | 14,795  |                      |
| ゼリア新薬工業               | 12.1  | 26,257    |                      | ニチハ                    | 8.5   | 37,060  |                      | 川田テクノロジーズ          | 1.2   | 7,488   |                      | レオン自動車           | 5.4   | 9,174   |                      |
| 第一三共                  | 157.4 | 426,239   |                      | <b>鉄鋼 (1.2%)</b>       |       |         |                      | 東洋製鐵グループHD         | 36.4  | 67,376  |                      | SMC              | 17.3  | 786,631 |                      |
| キョーリン製薬HD             | 14.7  | 31,502    |                      | 新日鐵住金                  | 244.5 | 665,284 |                      | ホッカンホールディングス       | 18    | 8,244   |                      | ホソカワミクロン         | 2.1   | 15,435  |                      |
| 大幸薬品                  | 4     | 10,052    |                      | 神戸製鋼所                  | 99.8  | 105,089 |                      | 横河ブリッジHLDGS        | 10.2  | 24,225  |                      | ユニオンツール          | 2.7   | 11,353  |                      |
| ダイト                   | 3.9   | 12,109    |                      | 中山製鋼所                  | 3.1   | 6,542   |                      | 駒井ハルテック            | 3.1   | 8,366   |                      | オイレス工業           | 7.1   | 16,848  |                      |
| 大塚ホールディングス            | 115   | 572,010   |                      | 合同製鐵                   | 9.7   | 8,021   |                      | 三和ホールディングス         | 52.5  | 77,752  |                      | 日精エーエスピー         | 2     | 12,940  |                      |
| 大正製薬HD                | 12.3  | 109,716   |                      | JFEホールディングス            | 147.6 | 389,959 |                      | 文化シヤッター            | 17.6  | 20,504  |                      | サトーホールディングス      | 7.4   | 23,310  |                      |
| ペプチドリーム               | 22.8  | 85,386    |                      | 日新製鋼                   | 15.1  | 26,123  |                      | 三協立山               | 8.2   | 13,005  |                      | 技研製作所            | 3     | 9,300   |                      |
| <b>石油・石炭製品 (0.6%)</b> |       |           |                      | 東京製鐵                   | 29.4  | 28,635  |                      | アルインコ              | 7.5   | 9,262   |                      | 日精樹脂工業           | 5.7   | 9,752   |                      |
| 日本コークス工業              | 60.6  | 7,453     |                      | 共英製鋼                   | 6.3   | 12,625  |                      | LIXILグループ          | 80.7  | 238,468 |                      | 小松製作所            | 267.1 | 929,508 |                      |
| 昭和シェル石油               | 50.9  | 72,888    |                      | 大和工業                   | 11.2  | 34,048  |                      | 日本ファイルコン           | 11.7  | 8,739   |                      | 住友重機械            | 31.2  | 142,428 |                      |
| ニチレキ                  | 7.9   | 10,728    |                      | 東京鐵鋼                   | 3.7   | 7,144   |                      | ノーリツ               | 12.2  | 26,510  |                      | 日立建機             | 25.8  | 95,847  |                      |
| ユシロ化学                 | 5.3   | 8,495     |                      | 大阪製鐵                   | 3.9   | 9,207   |                      | 長府製作所              | 6.6   | 17,773  |                      | 巴工業              | 4.5   | 9,747   |                      |



| 銘柄            | 2017年11月30日現在<br>株数 評価額 | 銘柄            | 2017年11月30日現在<br>株数 評価額 | 銘柄             | 2017年11月30日現在<br>株数 評価額 | 銘柄                  | 2017年11月30日現在<br>株数 評価額 |
|---------------|-------------------------|---------------|-------------------------|----------------|-------------------------|---------------------|-------------------------|
| 井関農機          | 千株 千円<br>5.5 15,086     | 日本精工          | 千株 千円<br>113 191,083    | セイコーエプソン       | 千株 千円<br>82.1 223,312   | OBARA GROUP         | 千株 千円<br>3.3 26,004     |
| TOWA          | 4.7 10,532              | NTN           | 123.1 67,828            | ワコム            | 43.9 26,647             | コーセル                | 4.2 12,751              |
| 丸山製作所         | 5 10,480                | ジェイテクト        | 57.2 110,338            | アルパック          | 9.3 70,029              | イリソ電子工業             | 8.7 31,349              |
| 北川鉄工所         | 3.4 9,870               | 不二越           | 49 34,594               | E I Z O        | 5.1 24,403              | オプテックスグループ          | 4.7 22,630              |
| ローツェ          | 3 8,043                 | 日本トムソン        | 19.1 14,019             | ジャパンディスプレイ     | 115.7 23,024            | 千代田インテグレ            | 3 8,097                 |
| クボタ           | 297.8 631,336           | T H K         | 34.2 140,391            | 日本信号           | 15.2 18,361             | レーザータック             | 12.4 33,852             |
| 三菱化工機         | 3.2 7,353               | ユースン精機        | 2.9 9,686               | 京三製作所          | 17 10,608               | スタンレー電気             | 42.1 188,818            |
| 月島機械          | 11.3 14,125             | イーグル工業        | 6.8 13,783              | 能美防災           | 7.6 15,838              | 岩崎電気                | 3.8 6,403               |
| 帝国電機製作所       | 6.3 9,090               | 日本ピラー工業       | 6.3 9,790               | ホーチキ           | 4.6 11,753              | ウシオ電機               | 32.9 53,232             |
| 新東工業          | 13.4 18,425             | キッツ           | 24.9 20,642             | エレコム           | 4.9 12,509              | ヘリオステクノH            | 8.7 9,570               |
| 渋谷工業          | 5 20,625                | マキタ           | 71.8 333,152            | パナソニック         | 630.4 1,051,507         | 日本セラミック             | 5.7 17,356              |
| アイチ コーポレーション  | 9.6 7,651               | 日立造船          | 41.8 24,327             | アンリツ           | 40.4 43,228             | 古河電池                | 5.3 5,633               |
| 小森コーポレーション    | 13.8 21,707             | 三菱重工業         | 92.1 382,215            | 富士通ゼネラル        | 17.1 40,715             | 山一電機                | 4.4 9,372               |
| 鶴見製作所         | 4.9 8,918               | I H I         | 42.3 146,569            | 五国国際電気         | 10.9 34,771             | 図研                  | 4.7 8,624               |
| 住友精密          | 27 10,125               | スター精密         | 8.6 15,815              | ソニー            | 368.7 1,917,608         | 日本電子                | 21 13,776               |
| 酒井重工業         | 1.8 7,749               | 電気機器 (14.0%)  |                         | T D K          | 28.6 262,262            | カシオ                 | 44 72,248               |
| 荏原製作所         | 22.5 98,662             | 日清紡ホールディングス   | 33.7 52,976             | 帝国通信工業         | 7.1 9,038               | ファナック               | 52.5 1,467,112          |
| 西島製作所         | 6.9 7,838               | イビデン          | 33.6 60,043             | タムラ製作所         | 22.8 18,445             | 日本シイエムケイ            | 10.1 10,716             |
| 北越工業          | 7.7 9,170               | コニカミノルタ       | 127.3 139,520           | アルプス電気         | 47.4 169,455            | エンプラス               | 2.6 12,051              |
| ダイキン工業        | 75.6 976,752            | ブラザー工業        | 67.3 186,824            | 池上通信機          | 40 7,240                | 大真空                 | 3.7 6,201               |
| オルガノ          | 2.8 8,206               | ミネベアミツミ       | 102.5 227,037           | パイオニア          | 92.2 20,099             | ローム                 | 24.8 285,200            |
| トーヨーカネツ       | 2.5 10,475              | 日立            | 1,324 1,104,480         | 日本電波工業         | 8.1 6,350               | 浜松ホトニクス             | 39.5 152,075            |
| 栗田工業          | 30 105,450              | 三菱電機          | 552.8 1,024,062         | 日本トリム          | 1.4 7,756               | 三井ハイテック             | 7.5 17,565              |
| 椿本チエイン        | 31 27,621               | 富士電機          | 165 130,680             | ローランド ディー. ジー. | 3.3 10,494              | 新光電気工業              | 21.5 18,490             |
| アネスト岩田        | 10.3 12,596             | 東洋電機製造        | 3.5 6,489               | フスター電機         | 6.8 19,958              | 京セラ                 | 90.5 715,040            |
| ダイフク          | 27.5 168,300            | 安川電機          | 64.1 317,295            | クラリオン          | 30 13,080               | 太陽誘電                | 24.2 45,399             |
| 加藤製作所         | 2.8 8,666               | シンフォニア テクノロジー | 37 16,021               | S M K          | 16 8,224                | 村田製作所               | 57.9 878,053            |
| 油研工業          | 3.5 9,782               | 明電舎           | 47 21,808               | ヨコオ            | 4.7 6,739               | ユージン                | 13.2 10,137             |
| タダノ           | 25.8 44,014             | オリジン電気        | 4 6,924                 | ホシデン           | 14.1 24,942             | 双葉電子工業              | 8.7 20,331              |
| フジテック         | 17.2 29,222             | 山洋電気          | 2.8 22,820              | ヒロセ電機          | 8.8 147,312             | 北陸電気工業              | 4.5 8,203               |
| C K D         | 15.5 37,804             | デンヨー          | 5.4 10,454              | 日本航空電子         | 14 28,210               | ニチコン                | 17 25,262               |
| キトー           | 5.3 9,073               | 東芝テック         | 39 27,612               | T O A          | 7.1 9,819               | 日本ケミコン              | 4.6 17,227              |
| 平和            | 16.8 32,558             | マブチモーター       | 15.2 90,896             | マクセルホールディングス   | 11.1 25,419             | K O A               | 8.1 18,395              |
| 理想科学工業        | 5.7 12,215              | 日本電産          | 66.5 1,015,455          | 古野電気           | 9.6 7,862               | 市光工業                | 9.4 10,246              |
| S A N K Y O   | 13.4 48,575             | 東光高岳          | 3.3 6,075               | ユニデンホールディングス   | 22 6,666                | 小糸製作所               | 33.2 257,300            |
| 日本金銭機械        | 6.5 7,338               | ダブル・スコープ      | 8.1 18,030              | アルパイン          | 13.3 34,460             | ミツバ                 | 10.5 16,086             |
| マースエンジニアリング   | 4.1 9,659               | ダイヘン          | 30 30,120               | スミダコーポレーション    | 5.9 11,693              | S C R E E Nホールディングス | 10.5 105,630            |
| 福島工業          | 3.6 18,900              | ヤーマン          | 7.4 15,073              | アイコム           | 3.6 9,086               | キャノン電子              | 5.6 13,888              |
| ダイコク電機        | 4.2 7,744               | J V Cケンウッド    | 43.6 15,042             | リオン            | 3.6 8,557               | キャノン                | 297.2 1,277,365         |
| 竹内製作所         | 9.1 21,521              | 第一精工          | 2.9 8,673               | 本多通信工業         | 6.2 7,210               | リコー                 | 165.7 165,037           |
| アmano         | 17 49,844               | 日新電機          | 13 17,576               | 船井電機           | 7.2 6,213               | 東京エレクトロン            | 36.9 766,044            |
| J U K I       | 8.5 16,600              | 大崎電気          | 12.8 10,163             | 横河電機           | 54.7 113,229            | 輸送用機器 (8.8%)        |                         |
| サンデンホールディングス  | 7.1 15,073              | オムロン          | 58.7 389,181            | 新電元工業          | 2.1 16,317              | トヨタ紡織               | 15.9 36,983             |
| マックス          | 8.8 13,842              | 日東工業          | 8.9 16,456              | アズビル           | 16.3 79,218             | ユニプレス               | 10.4 30,908             |
| グローリー         | 16.4 65,436             | I D E C       | 7.4 21,119              | 日本光電工業         | 23 59,225               | 豊田自動織機              | 44.7 311,559            |
| 新晃工業          | 6.1 13,438              | シーエス・ユアサ コーポ  | 97 56,260               | 共和電業           | 19.5 8,892              | モリタホールディングス         | 9.2 19,228              |
| 大和冷機工業        | 10 12,510               | メルコホールディングス   | 2.7 9,976               | 堀場製作所          | 10.8 75,600             | 三桜工業                | 9.7 8,167               |
| セガサミーホールディングス | 54.7 74,282             | 日本電気          | 71.1 213,300            | アドバンテスト        | 31 69,285               | デンソー                | 122.8 774,254           |
| 日本ピストンリング     | 3.6 8,085               | 富士通           | 569 475,058             | エスベック          | 5.1 14,050              | 東海理化電機              | 14 32,662               |
| リケン           | 2.7 16,308              | 沖電気           | 22.1 35,735             | ケーエンス          | 27.1 1,759,061          | 三井造船                | 17.9 29,123             |
| T P R         | 6.2 23,777              | 電気興業          | 3.8 10,982              | 日置電機           | 3.6 9,230               | 川崎重工業               | 42.3 156,933            |
| ツバキ・ナカシマ      | 5.6 13,988              | サンケン電気        | 33 22,143               | シスメックス         | 43.1 367,212            | 名村造船所               | 18.2 12,503             |
| ホンザギ          | 17.5 187,075            | アイホン          | 4.9 9,393               | 日本マイクロニクス      | 10.6 11,532             | 日本車輛                | 25 8,750                |
| 大豊工業          | 5.1 8,823               | ルネサスエレクトロニクス  | 29.9 41,052             | メガチップス         | 4.5 15,367              | 三菱ロジスネクスト           | 7.2 6,796               |

## トピックス・インデックス・マザーファンド

| 銘柄          | 2017年11月30日現在 |           | 銘柄           | 2017年11月30日現在 |           | 銘柄           | 2017年11月30日現在 |         | 銘柄              | 2017年11月30日現在 |         |
|-------------|---------------|-----------|--------------|---------------|-----------|--------------|---------------|---------|-----------------|---------------|---------|
|             | 株数            | 評価額       |              | 株数            | 評価額       |              | 株数            | 評価額     |                 | 株数            | 評価額     |
| 日産自動車       | 千株            | 千円        | タムロン         | 千株            | 千円        | 北海道電力        | 千株            | 千円      | ANAホールディングス     | 千株            | 千円      |
| いすゞ自動車      | 649.9         | 707,091   | HOYA         | 4.6           | 11,191    | 沖縄電力         | 54.9          | 44,304  | 倉庫・運輸関連業 (0.2%) | 102.5         | 459,200 |
| トヨタ自動車      | 160.4         | 284,068   | ノーリツ銅機       | 113.6         | 618,892   | 電源開発         | 9.1           | 26,672  | トランコム           | 1.7           | 12,444  |
| 日野自動車       | 671.4         | 4,729,341 | エー・アンド・デイ    | 6.1           | 13,005    | イーレックス       | 43.8          | 136,656 | 日新              | 4.9           | 15,165  |
| 三菱自動車工業     | 79            | 108,546   | シチズン時計       | 13.4          | 10,237    | 東京瓦斯         | 9.2           | 10,120  | 三菱倉庫            | 17.7          | 53,100  |
| エフテック       | 204.8         | 160,768   | リズム時計        | 63.7          | 51,915    | 大阪瓦斯         | 118.1         | 311,193 | 三井倉庫HOLD        | 37            | 13,320  |
| 武蔵精密工業      | 4.6           | 8,519     | メニコン         | 4             | 9,440     | 東邦瓦斯         | 107           | 230,799 | 住友倉庫            | 36            | 28,656  |
| 日産車体        | 6             | 20,250    | セイコーHD       | 4             | 23,400    | 北海道瓦斯        | 27.3          | 87,087  | 渋沢倉庫            | 36            | 28,656  |
| 新明和工業       | 21.6          | 24,775    | ニプロ          | 8.1           | 24,664    | 西部瓦斯         | 33            | 9,537   | 東陽倉庫            | 6.7           | 12,837  |
| 極東開発工業      | 23.5          | 25,309    | その他製品 (2.1%) | 38            | 61,712    | 静岡ガス         | 7.5           | 19,927  | 日本トランスシティ       | 29.2          | 9,548   |
| 日信工業        | 10.3          | 19,909    | パラマウントベッドHD  | 16.3          | 15,876    | メタウォーター      | 19            | 8,721   | 東洋埠頭            | 6.2           | 11,358  |
| トピー工業       | 11.2          | 24,561    | S HO - B I   | 3.2           | 9,142     | 陸運業 (4.0%)   | 33            | 81,642  | キューソー流通システム     | 2.2           | 7,018   |
| ティラド        | 4.7           | 16,003    | ニホンフラッシュ     | 58.9          | 210,567   | 東武鉄道         | 6.4           | 9,580   | 郵船ロジスティクス       | 10.1          | 22,452  |
| 曙ブレーキ       | 2.3           | 8,901     | 相鉄ホールディングス   | 17.4          | 50,860    | 東京急行         | 5.5           | 10,164  | 近鉄エクスプレス        | 5.7           | 16,689  |
| タチエス        | 27.2          | 9,302     | 東京急行         | 150.3         | 269,187   | 京浜急行         | 4.7           | 18,776  | デジタルアーツ         | 2.9           | 14,108  |
| NOK         | 9.5           | 19,978    | 京浜急行         | 76.2          | 165,125   | 小田急電鉄        | 8.6           | 24,957  | 新日鉄住金SOLO       | 8.1           | 6,504   |
| フタバ産業       | 29.4          | 80,320    | 小田急電鉄        | 82.3          | 196,285   | 京王電鉄         | 8.1           | 6,504   | コア              | 3.2           | 5,184   |
| KYB         | 17.2          | 18,025    | 京王電鉄         | 30.8          | 152,768   | 京成電鉄         | 5.4           | 8,483   | ソフトクリエイイトHD     | 18.1          | 69,142  |
| 大同メタル工業     | 5.8           | 38,396    | 京成電鉄         | 38.5          | 138,600   | 富士急行         | 4.4           | 9,253   | 電算システム          | 34.5          | 25,219  |
| プレス工業       | 8             | 8,032     | 富士急行         | 7.7           | 23,639    | 東日本旅客鉄道      | 9.2           | 21,224  | 三菱総合研究所         | 2.9           | 10,904  |
| 太平洋工業       | 29.8          | 19,936    | 東日本旅客鉄道      | 99.4          | 1,079,981 | 西日本旅客鉄道      | 10.8          | 20,498  | K L a b         | 5             | 9,145   |
| ケーヒン        | 11.7          | 18,872    | 西日本旅客鉄道      | 49.9          | 412,024   | 東海旅客鉄道       | 60.9          | 196,098 | ボルトウウィン・ビットフル   | 13.6          | 11,968  |
| 河西工業        | 12.6          | 27,770    | 東海旅客鉄道       | 49.6          | 1,030,440 | 西武ホールディングス   | 4.1           | 11,672  | エイチーム           | 6.4           | 6,137   |
| アイシン精機      | 7.1           | 13,894    | 西武ホールディングス   | 70.2          | 142,435   | 鴻池運輸         | 17.6          | 20,345  | ブロードリーフ         | 14.5          | 16,733  |
| マツダ         | 45.5          | 273,455   | 鴻池運輸         | 8             | 14,840    | 西日本鉄道        | 3.8           | 7,018   | メディアットHDGS      | 2.4           | 5,812   |
| 今仙電機製作所     | 172.3         | 258,966   | 西日本鉄道        | 15.2          | 44,384    | ハマキョウレックス    | 5.5           | 13,486  | 豆蔵ホールディングス      | 6.5           | 8,131   |
| 本田技研        | 7.3           | 9,752     | ハマキョウレックス    | 4.2           | 13,125    | サカイ引越センター    | 147.9         | 42,299  | GMOペイメントゲートウェイ  | 4             | 33,040  |
| スズキ         | 496.5         | 1,858,896 | サカイ引越センター    | 3.1           | 17,577    | 近鉄グループHDGS   | 9.6           | 21,004  | インターネットインシアティブ  | 7.4           | 6,164   |
| SUBARU      | 109.6         | 661,984   | 近鉄グループHDGS   | 52.2          | 229,419   | 阪急阪神HLDGS    | 7.4           | 6,164   | S R Aホールディングス   | 3.4           | 11,866  |
| 安永          | 171.4         | 628,866   | 阪急阪神HLDGS    | 70            | 304,500   | 南海電鉄         | 7.5           | 6,442   | 朝日ネット           | 4.1           | 10,245  |
| ヤマハ発動機      | 2.8           | 7,453     | 南海電鉄         | 25            | 70,075    | 京阪ホールディングス   | 7.1           | 7,597   | コムチュア           | 1.1           | 8,470   |
| ショーフ        | 77.8          | 273,856   | 京阪ホールディングス   | 23.1          | 76,807    | 名古屋鉄道        | 15.6          | 74,724  | L I N E         | 15.6          | 74,724  |
| ショーフ        | 14.7          | 20,036    | 名古屋鉄道        | 40.2          | 110,188   | 山陽電鉄         | 6             | 7,746   | マクロミル           | 7.4           | 21,556  |
| TBK         | 22.4          | 11,916    | 山陽電鉄         | 4.9           | 14,053    | 日本通運         | 7.5           | 6,442   |                 |               |         |
| エクセディ       | 6.2           | 20,739    | 日本通運         | 20.4          | 145,452   | ヤマトホールディングス  |               |         |                 |               |         |
| 豊田合成        | 19.6          | 55,017    | ヤマトホールディングス  | 91.9          | 209,118   | 山丸           |               |         |                 |               |         |
| 愛三工業        | 10            | 12,790    | 山丸           | 13.3          | 63,574    | 丸全昭和運輸       |               |         |                 |               |         |
| ヨロズ         | 5.7           | 14,158    | 丸全昭和運輸       | 22            | 11,000    | セゾングループHLDGS |               |         |                 |               |         |
| エフ・シー・シー    | 8.9           | 25,249    | セゾングループHLDGS | 31.7          | 25,423    | トナミホールディングス  |               |         |                 |               |         |
| シマノ         | 22.4          | 347,648   | トナミホールディングス  | 1.5           | 7,192     | ニッコンホールディングス |               |         |                 |               |         |
| ティ・エス テック   | 12.8          | 58,816    | ニッコンホールディングス | 19.5          | 58,987    | 福山通運         |               |         |                 |               |         |
| ジャムコ        | 2.9           | 8,381     | 福山通運         | 7.5           | 30,300    | セイノーホールディングス |               |         |                 |               |         |
| 精密機器 (1.6%) |               |           | セイノーホールディングス | 38.7          | 68,615    | 日立物流         |               |         |                 |               |         |
| テルモ         | 84.6          | 455,148   | 日立物流         | 11.7          | 32,678    | 丸和運輸機関       |               |         |                 |               |         |
| 日機装         | 19.1          | 21,143    | 丸和運輸機関       | 3.2           | 9,792     | 九州旅客鉄道       |               |         |                 |               |         |
| 島津製作所       | 65.5          | 175,343   | 九州旅客鉄道       | 43.9          | 152,333   | 海運業 (0.2%)   |               |         |                 |               |         |
| 長野計器        | 7.5           | 10,117    | 海運業 (0.2%)   |               |           | 日本郵船         |               |         |                 |               |         |
| アイ・テクノロジー   | 1.3           | 24,349    | 日本郵船         | 43.2          | 113,097   | 商船三井         |               |         |                 |               |         |
| 東京計器        | 4.8           | 6,672     | 商船三井         | 32.6          | 117,360   | 川崎汽船         |               |         |                 |               |         |
| 東京精密        | 9.8           | 45,619    | 川崎汽船         | 24            | 69,456    | N S ユナイテッド海運 |               |         |                 |               |         |
| マニー         | 6.9           | 22,218    | N S ユナイテッド海運 | 2.6           | 6,923     | 飯野海運         |               |         |                 |               |         |
| ニコン         | 96.1          | 214,014   | 飯野海運         | 27.8          | 17,236    | 空運業 (0.6%)   |               |         |                 |               |         |
| トプコン        | 29.7          | 73,982    | 空運業 (0.6%)   |               |           | 日本航空         |               |         |                 |               |         |
| オリンパス       | 82.3          | 379,403   | 日本航空         | 96.7          | 398,017   |              |               |         |                 |               |         |
| 理研計器        | 5.9           | 14,897    |              |               |           |              |               |         |                 |               |         |



| 銘柄             | 2017年11月30日現在 |            | 銘柄              | 2017年11月30日現在 |           | 銘柄           | 2017年11月30日現在 |           | 銘柄               | 2017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       |
| 野村総合研究所        | 千株 36.5       | 千円 185,420 | S C S K         | 千株 13.3       | 千円 65,369 | ダイトロン        | 千株 3.8        | 千円 8,728  | オートバックスセブン       | 千株 21.1       | 千円 45,407 |
| インテージホールディングス  | 7.5           | 10,432     | アイネス            | 10.8          | 11,728    | シークス         | 3.3           | 15,675    | 加藤産業             | 8.5           | 34,382    |
| クレスコ           | 1.7           | 8,211      | T K C           | 5.3           | 20,431    | 伊藤忠          | 399.2         | 776,843   | イノテック            | 7.2           | 7,272     |
| フジ・メディア・HD     | 55.7          | 93,241     | 富士ソフト           | 7.5           | 25,987    | 丸紅           | 444.3         | 331,358   | イエローハット          | 5.3           | 17,357    |
| オービック          | 17.3          | 134,767    | コナミ             | 9.1           | 21,011    | 高島           | 3.3           | 7,233     | 日伝               | 5.3           | 12,317    |
| ジャストシステム       | 9.3           | 19,678     | コナミホールディングス     | 22.3          | 132,239   | 長瀬産業         | 31.4          | 64,464    | 北沢産業             | 33.1          | 9,499     |
| ヤフー            | 395.7         | 202,994    | J B C Cホールディングス | 10.4          | 10,722    | 蝶理           | 4.1           | 8,532     | 因幡電機産業           | 6.8           | 35,768    |
| トレンドマイクロ       | 26.5          | 168,275    | ミロク情報サービス       | 5.1           | 14,973    | 豊田通商         | 60.6          | 255,732   | バイテックホールディングス    | 3.7           | 6,338     |
| 日本オラクル         | 9             | 89,820     | ソフトバンクグループ      | 245.4         | 2,327,619 | 兼松           | 23.3          | 31,361    | ミスミグループ本社        | 63            | 206,325   |
| フューチャー         | 9.7           | 11,998     | 卸売業 (4.4%)      |               |           | ツカモトコーポレーション | 6.8           | 8,602     | スズケン             | 24.6          | 109,224   |
| CAC HOLDINGS   | 7.6           | 7,987      | エレマテック          | 2.9           | 7,641     | 三井物産         | 460.8         | 785,664   | ジェコス             | 5.1           | 7,170     |
| オービックビジネスC     | 3             | 17,040     | J A L U X       | 2.6           | 7,381     | 日本紙パルプ       | 2.8           | 12,026    | 小売業 (4.7%)       |               |           |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 12.5          | 59,062     | あらた             | 2.8           | 16,520    | 日立ハイテクノロジーズ  | 18.9          | 87,790    | ローソン             | 13.7          | 106,038   |
| アイティフォー        | 14            | 10,794     | 東京エレクトロンデバイス    | 4.1           | 8,417     | カメイ          | 7.2           | 13,032    | サンエー             | 4.2           | 21,798    |
| 大塚商会           | 16.5          | 138,600    | フィールズ           | 5.5           | 6,979     | スターゼン        | 2.4           | 12,984    | カワチ薬品            | 4.5           | 12,600    |
| サイボウズ          | 15.2          | 7,630      | 双日              | 31.5          | 102,060   | 山善           | 20.9          | 26,689    | エーピージー・マート       | 9.7           | 59,752    |
| 電通国際情報S        | 3.8           | 9,173      | アルフレッサホールディングス  | 59.8          | 144,237   | 住友商事         | 341.3         | 595,056   | ハードオフコーポレーション    | 6.5           | 8,248     |
| デジタルガレージ       | 10.2          | 29,488     | 横浜冷凍            | 13.8          | 15,442    | 内田洋行         | 3.1           | 9,951     | アスクル             | 5.8           | 18,154    |
| イーエスシステムズ      | 3.1           | 7,746      | 山下医科器械          | 5.6           | 9,716     | 三菱商事         | 381.8         | 1,074,003 | グオホールディングス       | 10.4          | 23,680    |
| ウェザーニューズ       | 2.5           | 8,600      | アルコニック          | 6.5           | 13,975    | 第一実業         | 3.1           | 10,524    | アダストリア           | 8.4           | 20,874    |
| C I J          | 13.8          | 9,798      | 神戸物産            | 3.6           | 18,360    | キャンマークティンJPN | 15.8          | 45,346    | くらコーポレーション       | 3.3           | 17,292    |
| WOWOW          | 3             | 9,690      | ペッパーフードサービス     | 3             | 21,120    | 西華産業         | 3.7           | 10,078    | パルグループHLDGS      | 3             | 10,395    |
| ネットワンシステムズ     | 22.9          | 36,869     | あいホールディングス      | 7.9           | 21,116    | 菱洋エレクトロ      | 5.6           | 10,752    | エディオン            | 20.6          | 25,976    |
| アルゴグラフィックス     | 3.2           | 11,312     | ディー・ブイエックス      | 4.7           | 6,467     | ユアサ商事        | 5.1           | 20,094    | サウコーポレーション       | 10.8          | 7,462     |
| マーベラス          | 9.9           | 10,216     | ダイワボウHD         | 4.7           | 20,633    | 神鋼商事         | 2             | 6,080     | ワッツ              | 5.8           | 6,844     |
| エイベックス         | 10.2          | 15,799     | マクニカ・富士エレHLDGS  | 10.3          | 24,781    | 阪和興業         | 10.1          | 45,702    | ハローズ             | 2.5           | 6,495     |
| 日本ユニシス         | 15            | 33,045     | パイタルK S K HD    | 10.3          | 9,723     | 正栄食品         | 3.2           | 15,200    | あみやき亭            | 2.2           | 11,132    |
| 兼松エレクトロニクス     | 3.7           | 12,191     | UKCホールディングス     | 4.4           | 8,492     | カナデン         | 8.4           | 11,650    | ひらまつ             | 14.8          | 8,288     |
| 東京放送HD         | 32.8          | 90,298     | TOKAIホールディングス   | 29.2          | 25,491    | 菱電商事         | 5             | 8,685     | ゲンキー             | 2.5           | 10,462    |
| 日本テレビHLD S     | 49.5          | 100,534    | 三洋貿易            | 3.8           | 9,378     | 岩谷産業         | 11.5          | 38,985    | 大黒天物産            | 1.6           | 8,416     |
| テレビ朝日HD        | 14.9          | 35,581     | ウイン・パートナーズ      | 5.2           | 6,557     | すてきナイスグループ   | 6.1           | 9,412     | ハニースホールディングス     | 6.8           | 7,820     |
| スカパーJ SATHD    | 40.7          | 20,350     | シブヘルスケアHD       | 11            | 39,545    | 極東貿易         | 20            | 8,900     | アルペン             | 4.5           | 10,336    |
| テレビ東京HD        | 4.9           | 11,985     | コマダホールディングス     | 10.4          | 20,228    | イワキ          | 14            | 6,846     | クオール             | 5.9           | 12,679    |
| 日本BS放送         | 5.5           | 7,029      | 小野建             | 5.3           | 10,785    | 三菱石油         | 14.4          | 23,155    | ジンズ              | 3.7           | 21,312    |
| ワイヤレスゲート       | 4.6           | 5,929      | 佐島電機            | 8.7           | 8,630     | 稲畑産業         | 12.9          | 22,433    | ビックカメラ           | 31.6          | 45,251    |
| コネクシオ          | 4             | 8,740      | 伯東              | 3.9           | 7,472     | ワキタ          | 12.3          | 16,334    | DCMホールディングス      | 27.9          | 30,271    |
| 日本通信           | 64.7          | 7,828      | コンドーテック         | 8             | 8,768     | 東邦ホールディングス   | 15.4          | 35,928    | MonotaRO         | 19.6          | 62,524    |
| 日本電信電話         | 388.9         | 2,286,343  | ナガイレーベン         | 7.2           | 19,346    | サンゲツ         | 17.9          | 36,677    | アークランドサービスHD     | 5             | 13,835    |
| KDDI           | 487.6         | 1,567,634  | 三菱食品            | 5.9           | 20,178    | ミツウロコグループ    | 8.9           | 7,315     | J. フロント リテイリング   | 65.1          | 123,364   |
| 光通信            | 6.6           | 106,788    | 松田産業            | 5.8           | 10,846    | シナネホールディングス  | 3.2           | 8,032     | ドトール・日レスHD       | 9.9           | 26,571    |
| NTTドコモ         | 401.3         | 1,166,779  | 第一興商            | 8             | 43,040    | 伊藤忠エネクス      | 11.3          | 12,712    | マツモトキヨシHLDGS     | 11.4          | 105,792   |
| エムティーアイ        | 10            | 6,520      | メディアパルHD        | 54.4          | 118,537   | サンリオ         | 15.1          | 28,161    | ブロンコビリー          | 3.5           | 11,112    |
| GMOインターネット     | 20.6          | 38,707     | 秋原電気            | 2.5           | 8,562     | サンワ テクノス     | 4.2           | 8,547     | スタートトゥデイ         | 53.6          | 183,580   |
| カドカワ           | 16.2          | 20,849     | アズワン            | 4.3           | 27,692    | リョーサン        | 6.7           | 29,111    | 物語コーポレーション       | 1.7           | 16,643    |
| ゼンリン           | 6.8           | 25,806     | ドウシシャ           | 6             | 13,830    | 新光商事         | 6.6           | 13,015    | ココカラファイン         | 5.7           | 39,900    |
| 松竹             | 3.6           | 66,312     | 小津産業            | 4.9           | 10,711    | トーホー         | 4.1           | 11,242    | 三越伊勢丹HD          | 102.2         | 132,757   |
| 東宝             | 35.5          | 134,722    | 黒田電気            | 6.6           | 17,905    | 三信電気         | 5.2           | 8,814     | ウエルシアHD          | 14.6          | 70,226    |
| 東映             | 2             | 23,320     | 丸文              | 7.3           | 7,562     | 東陽テクニカ       | 10            | 9,580     | クリエイトSDH         | 8             | 23,424    |
| NTTデータ         | 170.3         | 224,966    | ハピネット           | 4.3           | 8,548     | モスフード サービス   | 7.3           | 25,148    | ジョイフル本田          | 8.9           | 28,524    |
| DT S           | 6.2           | 23,033     | 日本ライフライン        | 7.8           | 38,844    | 加賀電子         | 5             | 15,725    | 鳥貴族              | 2.4           | 7,524     |
| スクウェア・エニックス・HD | 25.4          | 129,794    | エクセル            | 3.1           | 7,712     | PAL TAC      | 7.6           | 37,848    | ホットランド           | 4.4           | 6,560     |
| シーエーシー         | 3.7           | 9,431      | マルカキカイ          | 3.4           | 7,340     | ヤマタネ         | 5.6           | 12,241    | すかいらーく           | 33.1          | 54,383    |
| カプコン           | 11.7          | 37,440     | I DOM           | 17.7          | 14,797    | 日鉄住金物産       | 3.9           | 23,088    | 綿半ホールディングス       | 3.2           | 8,288     |
| ジャステック         | 6             | 7,560      | 進和              | 4.7           | 12,050    | トラスコ中山       | 11.5          | 36,110    | ユナイテッド・スーパーマーケット | 18.1          | 20,796    |

## トピックス・インデックス・マザーファンド

| 銘柄               | 株数    | 千円        | 千円 | 銘柄              | 株数      | 千円        | 千円 | 銘柄           | 株数      | 千円        | 千円 | 銘柄                | 株数    | 千円        | 千円 |
|------------------|-------|-----------|----|-----------------|---------|-----------|----|--------------|---------|-----------|----|-------------------|-------|-----------|----|
| あさひ              | 5.2   | 7,165     |    | オークワ            | 9       | 10,206    |    | 武蔵野銀行        | 8.4     | 29,988    |    | 関西アーバン銀行          | 7.3   | 10,300    |    |
| 日本調剤             | 2     | 7,330     |    | コメリ             | 8.1     | 25,920    |    | 千葉興業銀行       | 19.1    | 11,402    |    | 栃木銀行              | 27.8  | 13,344    |    |
| コスモス薬品           | 2.7   | 68,229    |    | 青山商事            | 10.2    | 43,656    |    | 筑波銀行         | 33      | 12,738    |    | 北日本銀行             | 3.4   | 10,217    |    |
| セブン&アイ・HLDGS     | 228.4 | 1,051,782 |    | しまむら            | 6.3     | 85,239    |    | 七十七銀行        | 16.3    | 43,162    |    | 東和銀行              | 10.4  | 13,634    |    |
| 薬王堂              | 2.7   | 9,234     |    | 高島屋             | 85      | 94,095    |    | 青森銀行         | 4.2     | 15,057    |    | 福島銀行              | 10.9  | 9,919     |    |
| クリエイト・レストランツ・ホール | 15.5  | 19,034    |    | 松屋              | 12.5    | 16,637    |    | 秋田銀行         | 3.5     | 10,657    |    | 大東銀行              | 5.4   | 9,018     |    |
| ツルハホールディングス      | 11    | 170,720   |    | エイ・ツー・オーリテイリング  | 25.7    | 56,231    |    | 山形銀行         | 6       | 14,826    |    | トモニホールディングス       | 43.9  | 23,881    |    |
| サンマルクホールディングス    | 4.1   | 12,648    |    | 丸井グループ          | 52.3    | 103,867   |    | 岩手銀行         | 3.6     | 16,146    |    | フィデアホール           | 63.5  | 12,954    |    |
| トリドールホールディングス    | 6.8   | 24,616    |    | アクシアル リテイリング    | 4.7     | 19,881    |    | 東邦銀行         | 45.9    | 18,268    |    | 池田泉州HD            | 50.5  | 20,402    |    |
| TOKYO BASE       | 1.1   | 5,060     |    | イオン             | 209.4   | 381,945   |    | 東北銀行         | 8.3     | 12,508    |    | 証券・商品先物取引業 (1.0%) |       |           |    |
| ダイユー・リップHLDGS    | 9.1   | 9,837     |    | イズミ             | 10      | 65,900    |    | ふくおかフィナンシャルG | 218     | 126,876   |    | FPG               | 19.8  | 27,383    |    |
| クサリのアオキHLDGS     | 4.3   | 29,412    |    | 平和堂             | 10.9    | 26,399    |    | 静岡銀行         | 141     | 156,228   |    | SBIホールディングス       | 60.8  | 121,296   |    |
| スローグローバルHLDGS    | 5.1   | 19,788    |    | フジ              | 6.3     | 15,535    |    | 十六銀行         | 6.7     | 22,311    |    | ジャフコ              | 7.7   | 45,353    |    |
| LIXILビバ          | 5.3   | 9,434     |    | ヤオコー            | 6.4     | 33,856    |    | スルガ銀行        | 55.7    | 134,292   |    | 大和証券G本社           | 464   | 323,872   |    |
| 総合メディカル          | 2.6   | 15,730    |    | ゼビオホールディングス     | 7.2     | 14,882    |    | 八十二銀行        | 93.8    | 60,032    |    | 野村ホールディングス        | 980.6 | 657,492   |    |
| ノジマ              | 9.9   | 25,502    |    | ケーズホールディングス     | 22.8    | 66,028    |    | 山梨中央銀行       | 34      | 16,252    |    | 岡三証券グループ          | 45    | 30,870    |    |
| ライトオン            | 6.4   | 5,824     |    | アインホールディングス     | 7.8     | 59,670    |    | 大垣共立銀行       | 83      | 23,912    |    | 丸三証券              | 19.4  | 20,389    |    |
| 良品計画             | 7.2   | 252,360   |    | 元気寿司            | 3.5     | 15,645    |    | 福井銀行         | 4.9     | 13,391    |    | 東洋証券              | 32    | 10,368    |    |
| アドヴァン            | 6.6   | 6,844     |    | ヤマダ電機           | 179.2   | 109,312   |    | 北國銀行         | 6       | 26,130    |    | 東海東京HD            | 58.7  | 42,616    |    |
| アルビス             | 1.6   | 6,880     |    | アークランドサカモト      | 9.5     | 17,774    |    | 清水銀行         | 2.7     | 8,707     |    | 水戸証券              | 26.2  | 11,239    |    |
| コジマ              | 16.9  | 6,168     |    | ニトリホールディングス     | 21.7    | 397,869   |    | 滋賀銀行         | 46      | 26,680    |    | いちよし証券            | 13.6  | 17,408    |    |
| コーナン商事           | 7.9   | 18,486    |    | 吉野家ホールディングス     | 18      | 33,534    |    | 南都銀行         | 6.3     | 19,120    |    | 松井証券              | 24.5  | 24,083    |    |
| ワタミ              | 7.3   | 11,497    |    | 松屋フーズ           | 2.9     | 11,933    |    | 百五銀行         | 49.5    | 25,641    |    | マネックスG            | 58.8  | 19,227    |    |
| ドンキホーテホールディング    | 35.5  | 190,635   |    | サガミチェーン         | 10.9    | 15,194    |    | 京都銀行         | 20.5    | 117,260   |    | カブドットコム証券         | 35.6  | 12,175    |    |
| 西松屋チェーン          | 12.2  | 16,567    |    | 関西スーパーマーケット     | 5.3     | 6,688     |    | 紀陽銀行         | 19.8    | 37,164    |    | 極東証券              | 8.2   | 13,489    |    |
| ゼンショーホールディングス    | 28.4  | 53,960    |    | 王将フードサービス       | 3.9     | 19,422    |    | 三重銀行         | 3.8     | 9,629     |    | 岩井コスモホールディング      | 7.9   | 11,383    |    |
| 幸楽苑ホールディングス      | 7.3   | 12,928    |    | プレナス            | 6.2     | 14,545    |    | ほくほくフィナンシャルG | 34.7    | 58,122    |    | 藍澤證券              | 14.1  | 10,603    |    |
| サイゼリヤ            | 8.3   | 29,133    |    | ミネストップ          | 4.6     | 10,736    |    | 広島銀行         | 78.1    | 68,962    |    | 保険業 (2.3%)        |       |           |    |
| VTホールディングス       | 19.3  | 10,653    |    | アークス            | 9.9     | 25,680    |    | 山陰合同銀行       | 31.2    | 31,636    |    | かんぽ生命保険           | 20.6  | 50,387    |    |
| ポプラ              | 11.6  | 8,328     |    | パロウホールディングス     | 12.5    | 32,712    |    | 中国銀行         | 36.7    | 53,692    |    | SOMPOホールディングス     | 106.6 | 483,111   |    |
| ユナイテッドアローズ       | 6.7   | 28,408    |    | ベルク             | 2.7     | 16,983    |    | 伊予銀行         | 76      | 66,652    |    | アニコムホールディングス      | 4     | 12,920    |    |
| ハイドライド高          | 6.1   | 20,648    |    | ファーストリテイリング     | 9.1     | 395,941   |    | 百十四銀行        | 58      | 21,460    |    | MS & AD           | 142.1 | 519,375   |    |
| コロワイド            | 18.2  | 39,257    |    | サンドラッグ          | 23.2    | 119,944   |    | 四国銀行         | 8.4     | 13,297    |    | SONY FH           | 44.1  | 83,701    |    |
| ピーシーデポコーポ        | 8.9   | 8,241     |    | サックスパーホールディング   | 6       | 8,388     |    | 阿波銀行         | 41      | 28,331    |    | 第一生命HLDGS         | 307.7 | 706,479   |    |
| 壱番屋              | 3.8   | 16,739    |    | ベールーナ           | 14.2    | 17,423    |    | 大分銀行         | 2.9     | 12,905    |    | 東京海上HD            | 205.2 | 1,017,792 |    |
| スギホールディングス       | 11.8  | 71,036    |    | 銀行業 (7.3%)      |         |           |    | 宮崎銀行         | 3.6     | 12,906    |    | T&Dホールディングス       | 167.7 | 309,490   |    |
| ヴィア・ホールディングス     | 10.6  | 7,981     |    | じもとホールディングス     | 54.5    | 10,300    |    | 佐賀銀行         | 3.8     | 9,690     |    | アドバンスクリエイト        | 3.6   | 7,059     |    |
| スクロール            | 16.5  | 8,002     |    | めぶきフィナンシャルG     | 281.1   | 132,398   |    | 十八銀行         | 38      | 11,134    |    | その他金融業 (1.2%)     |       |           |    |
| ヨンドリーホールディングス    | 5.6   | 17,052    |    | 東京TYフィナンシャルG    | 7.4     | 22,200    |    | 沖縄銀行         | 5.1     | 22,414    |    | 全国保証              | 15.5  | 74,942    |    |
| ユニー・ファミリーマートHD   | 17.6  | 133,232   |    | 九州フィナンシャルG      | 88.1    | 58,498    |    | 琉球銀行         | 10.8    | 17,517    |    | クレディセゾン           | 41    | 88,519    |    |
| 木曽路              | 7.5   | 20,407    |    | ゆうちょ銀行          | 155.4   | 221,755   |    | セブン銀行        | 203.4   | 76,478    |    | 芙蓉総合リース           | 6.2   | 46,190    |    |
| 千趣会              | 15.2  | 10,275    |    | 富山第一銀行          | 19.1    | 9,702     |    | みずほフィナンシャルG  | 7,394.2 | 1,507,677 |    | 興銀リース             | 10    | 28,670    |    |
| タカキユー            | 33.4  | 7,715     |    | コンコルディア・フィナンシャル | 329.7   | 202,765   |    | 高知銀行         | 8.6     | 11,016    |    | 東京センチュリー          | 10.9  | 55,481    |    |
| ケーヨー             | 13.7  | 9,768     |    | 西日本フィナンシャルHD    | 36      | 45,252    |    | 山口フィナンシャルG   | 48      | 64,368    |    | 日本証券金融            | 23.7  | 14,457    |    |
| 上新電機             | 6.5   | 28,502    |    | 新生銀行            | 47      | 84,271    |    | 名古屋銀行        | 4.1     | 17,630    |    | アイフル              | 94.5  | 36,288    |    |
| 日本瓦葺             | 10.1  | 40,097    |    | あおぞら銀行          | 32      | 139,360   |    | 北洋銀行         | 78.2    | 28,152    |    | リコーリース            | 4.3   | 16,576    |    |
| ロイヤルホールディングス     | 9.9   | 30,541    |    | 三菱UFJフィナンシャルG   | 3,848.6 | 3,048,476 |    | 愛知銀行         | 1.9     | 11,989    |    | イオンフィナンシャルサービス    | 38.6  | 96,152    |    |
| いなげや             | 6.9   | 12,709    |    | りそなホールディングス     | 597.8   | 356,229   |    | 第三銀行         | 5.1     | 9,307     |    | アコム               | 114.8 | 53,611    |    |
| 島忠               | 14    | 45,220    |    | 三井住友トラストHD      | 107     | 445,548   |    | 中京銀行         | 3.1     | 7,223     |    | ジャックス             | 6.9   | 17,864    |    |
| チヨダ              | 6.3   | 18,427    |    | 三井住友フィナンシャルG    | 412.1   | 1,873,818 |    | 大光銀行         | 3.2     | 7,980     |    | オリコ               | 116.9 | 21,509    |    |
| ライフコーポレーション      | 4.3   | 12,921    |    | 第四銀行            | 6.5     | 31,882    |    | 愛媛銀行         | 7.7     | 10,895    |    | 日立キャピタル           | 14.8  | 40,936    |    |
| リンガーハット          | 7.1   | 18,318    |    | 北越銀行            | 5.9     | 14,726    |    | トマト銀行        | 8.3     | 12,806    |    | アプラスフィナンシャル       | 58.1  | 6,391     |    |
| MrMaxHD          | 9.7   | 8,245     |    | 千葉銀行            | 194     | 166,646   |    | みなと銀行        | 5.2     | 10,769    |    | オリックス             | 363.3 | 702,622   |    |
| AOKIホールディングス     | 10.5  | 17,220    |    | 群馬銀行            | 106.9   | 71,195    |    | 京葉銀行         | 45      | 22,995    |    | 三菱UFJリース          | 136.2 | 87,031    |    |

| 銘柄              | 2017年11月30日現在 |         | 銘柄            | 2017年11月30日現在 |           | 銘柄             | 2017年11月30日現在 |                |
|-----------------|---------------|---------|---------------|---------------|-----------|----------------|---------------|----------------|
|                 | 株数            | 評価額     |               | 株数            | 評価額       |                | 株数            | 評価額            |
| 日本取引所グループ       | 千株            | 千円      | パナソニックグループ    | 千株            | 千円        | フルキャストホールディングス | 千株            | 千円             |
| イー・ギャランティ       | 160.7         | 331,363 | CDS           | 5.1           | 8,812     | テクノプロ・ホールディング  | 5.2           | 11,304         |
| NECキャピタルソリューション | 2.4           | 7,920   | リンクアンドモチベーション | 6.3           | 8,404     | イー・ガーディアン      | 9.5           | 53,485         |
| 不動産業 (2.3%)     | 3.3           | 7,646   | GC A          | 11.1          | 9,856     | ジャパンマテリアル      | 3.3           | 7,623          |
| いちご             | 77.9          | 32,406  | エス・エム・エス      | 7.2           | 8,049     | ベクトル           | 5.1           | 16,983         |
| 日本駐車場開発         | 10.6          | 38,054  | パーソルホールディングス  | 10.6          | 38,054    | アサンテ           | 7             | 10,962         |
| ヒューリック          | 48.9          | 128,509 | リニカル          | 48.9          | 128,509   | N・フィールド        | 4.3           | 8,376          |
| 三栄建築設計          | 4.2           | 6,489   | クックパッド        | 4.2           | 6,489     | M&Aキャピタルパートナー  | 3.7           | 5,476          |
| 野村不動産HLDGS      | 17.4          | 11,658  | スタジオアリス       | 1.2           | 8,448     | エスコロー A J      | 1.2           | 8,448          |
| 三重交通グループHD      | 3.2           | 8,390   | シミックホールディングス  | 8.5           | 5,117     | ベルシステム24HLDGS  | 8.5           | 5,117          |
| サムティ            | 4.8           | 8,112   | 総合警備保障        | 5.3           | 7,372     | リクルートホールディングス  | 5.3           | 7,372          |
| 日本商業開発          | 21.1          | 131,453 | 力カクコム         | 408.3         | 1,080,770 | 日本郵政           | 298           | 385,016        |
| プレサンスコーポレーション   | 41.3          | 73,266  | ディップ          | 9.2           | 12,806    | ソラスト           | 9.2           | 12,806         |
| ユニソホールディングス     | 7.8           | 22,744  | オプトホールディング    | 3.7           | 9,941     | リログループ         | 3.7           | 9,941          |
| 日本管理センター        | 14.3          | 13,141  | ツクイ           | 29.2          | 87,249    | 東祥             | 3.7           | 12,802         |
| フージャースHD        | 55.9          | 206,271 | エムスリー         | 8.4           | 35,490    | 共立メンテナンス       | 9.5           | 38,380         |
| オープンハウス         | 16.1          | 31,749  | アウトソーシング      | 7.3           | 11,665    | イチネンホールディングス   | 7.9           | 8,958          |
| 東急不動産HD         | 5.7           | 6,897   | ウエルネット        | 1.1           | 8,778     | 建設技術研究所        | 5.4           | 8,100          |
| 飯田GHD           | 2             | 5,808   | ワールドホールディングス  | 1.6           | 7,912     | スバル興業          | 4.2           | 16,296         |
| パーク24           | 28.7          | 73,041  | ディー・エヌ・エー     | 6.5           | 12,064    | 東京テアトル         | 2.3           | 8,452          |
| パラカ             | 73.4          | 110,760 | 博報堂DYHLDGS    | 3.8           | 6,490     | よみうりランド        | 6.1           | 12,413         |
| 三井不動産           | 8.8           | 12,038  | ぐるなび          | 2.7           | 12,649    | 常盤興産           | 56            | 471,184        |
| 三菱地所            | 15.1          | 14,692  | ファンコミュニケーションズ | 3.5           | 7,143     | セコム            | 11.3          | 16,159         |
| 平和不動産           | 3             | 9,525   | WD Bホールディングス  | 6             | 35,400    | メイテック          | 10            | 36,600         |
| 東京建物            | 10.3          | 10,176  | ティア           | 6.7           | 10,184    | アサツキ ディ・ケイ     | 7.6           | 28,386         |
| ダイビル            | 7.6           | 5,852   | パリュウコマース      | 18.8          | 9,606     | 応用地質           | 5.5           | 8,822          |
| 京阪神ビルディング       | 28.2          | 19,232  | インフォマーズ       | 19.2          | 76,032    | 船井総研ホールディン     | 6.4           | 27,200         |
| 住友不動産           | 19.7          | 6,934   | J Pホールディングス   | 10.5          | 14,490    | オオバ            | 9.4           | 27,871         |
| 大京              | 8.4           | 20,286  | E P Sホールディングス | 19.2          | 76,032    | 学究社            | 6.4           | 27,200         |
| テオオーシー          | 12.2          | 10,162  | プレステージ・インター   | 10.5          | 14,490    | ベネッセホールディングス   | 19.2          | 76,032         |
| レオパレス21         | 3.9           | 12,265  | アミューズ         | 7.1           | 12,247    | イオンディライト       | 6.4           | 27,200         |
| スターツコーポレーション    | 2.6           | 6,338   | ドリムインキュベータ    | 16.5          | 28,512    | ニチイ学館          | 10.5          | 14,490         |
| フジ住宅            | 4.2           | 7,564   | クイック          | 22.6          | 55,505    | ダイセキ           | 9.4           | 27,871         |
| 空港施設            | 23.5          | 8,718   | TAC           | 7.2           | 19,483    | 合 計            | 株数            | 金額             |
| ゴールドクレスト        | 74            | 56,684  | ケネディクス        | 8.9           | 11,285    |                | 銘柄数<比率>       | 1,500銘柄<98.7%> |
| 日本エスリード         | 64.3          | 326,644 | 電通            | 10.4          | 8,933     |                |               |                |
| 日神不動産           | 2             | 13,400  | ぴあ            | 64.6          | 152,779   |                |               |                |
| 日本エスコン          | 1.9           | 9,291   | イオンファンタジー     | 35.1          | 134,433   |                |               |                |
| タカラレーベン         | 2.5           | 4,612   | ネクシエーズグループ    | 271.7         | 311,775   |                |               |                |
| サンヨーハウジング名古屋    | 15.3          | 74,587  | みらかホールディングス   | 9.6           | 9,292     |                |               |                |
| イオンモール          | 2.8           | 10,570  | アルプス技研        | 2.4           | 9,912     |                |               |                |
| トーセイ            | 62.6          | 625,436 | オリエンタルランド     |               |           |                |               |                |
| エヌ・ティ・ティ都市開発    | 14.2          | 41,577  | ダスキン          |               |           |                |               |                |
| サンフロンティア不動産     | 7.8           | 10,537  | 光明ネットワークジャパン  |               |           |                |               |                |
| エフ・ジェー・ネクスト     | 7.1           | 12,247  | ファルコホールディングス  |               |           |                |               |                |
| グランディハウス        | 16.5          | 28,512  | ラウンドワン        |               |           |                |               |                |
| 日本空港ビルデング       | 22.6          | 55,505  | リゾートトラスト      |               |           |                |               |                |
| サービス業 (4.2%)    | 7.2           | 19,483  | ビー・エム・エル      |               |           |                |               |                |
| 日本工営            | 8.9           | 11,285  | りらいあコミュニケーション |               |           |                |               |                |
| LIFULL          | 10.4          | 8,933   | リソー教育         |               |           |                |               |                |
| ジェイエイサーグループ     | 64.6          | 152,779 | ユー・エス・エス      |               |           |                |               |                |
| 日本M&Aセンター       | 35.1          | 134,433 | サイバーエージェント    |               |           |                |               |                |
| タケエイ            | 271.7         | 311,775 | 楽天            |               |           |                |               |                |
| トラスト・テック        | 9.6           | 9,292   | デー・オー・ダブリュ    |               |           |                |               |                |
| コジダホールディングス     | 2.4           | 9,912   | セントラルスポーツ     |               |           |                |               |                |

## (2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

| 銘柄別   | 2017年11月30日現在 |     |
|-------|---------------|-----|
|       | 買建額           | 売建額 |
| 国内    | 百万円           | 百万円 |
| TOPIX | 1,797         | —   |

(注) 単位未満は切捨て。

## ■有価証券の貸付および借入状況

| 区分 | 2017年11月30日現在               |               |
|----|-----------------------------|---------------|
|    | 貸付                          | 借入            |
| 株式 | 株<br>1,992,400<br>(364,300) | 株<br>—<br>(—) |

(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、大和証券へ364,300株を貸付けています。

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

# トピックス・インデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第29期（決算日 2017年9月19日）

（計算期間 2016年9月21日～2017年9月19日）

トピックス・インデックス・マザーファンドの第29期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                                                                                                                                                          |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。                                                                                                                                       |
| 主要投資対象 | 東京証券取引所第1部上場株式（上場予定を含みます。）                                                                                                                                                               |
| 運用方法   | 投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。<br>イ. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。<br>ロ. ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。<br>ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。 |
| 株式組入制限 | 無制限                                                                                                                                                                                      |

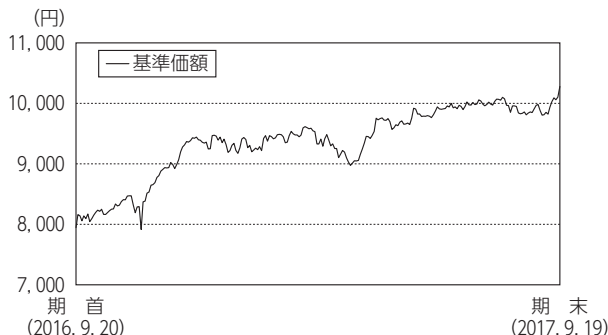
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

## ■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日            | 基 準 価 額 |      | T O P I X |      | 株 式 組 入 率 | 株 式 先 物 率 |
|------------------|---------|------|-----------|------|-----------|-----------|
|                  | 円       | 騰落率  | (ベンチマーク)  | 騰落率  | 比         | 比         |
| (期首) 2016年 9月20日 | 7,944   | —    | 1,316.97  | —    | 99.7      | 0.2       |
| 9月末              | 8,045   | 1.3  | 1,322.78  | 0.4  | 98.5      | 1.5       |
| 10月末             | 8,471   | 6.6  | 1,393.02  | 5.8  | 98.6      | 1.4       |
| 11月末             | 8,937   | 12.5 | 1,469.43  | 11.6 | 99.0      | 0.9       |
| 12月末             | 9,248   | 16.4 | 1,518.61  | 15.3 | 99.4      | 0.6       |
| 2017年 1月末        | 9,267   | 16.7 | 1,521.67  | 15.5 | 99.4      | 0.5       |
| 2月末              | 9,358   | 17.8 | 1,535.32  | 16.6 | 99.5      | 0.7       |
| 3月末              | 9,298   | 17.0 | 1,512.60  | 14.9 | 97.4      | 2.5       |
| 4月末              | 9,420   | 18.6 | 1,531.80  | 16.3 | 98.4      | 1.7       |
| 5月末              | 9,649   | 21.5 | 1,568.37  | 19.1 | 98.6      | 1.3       |
| 6月末              | 9,926   | 24.9 | 1,611.90  | 22.4 | 99.1      | 0.8       |
| 7月末              | 9,971   | 25.5 | 1,618.61  | 22.9 | 99.1      | 0.8       |
| 8月末              | 9,968   | 25.5 | 1,617.41  | 22.8 | 98.9      | 1.0       |
| (期末) 2017年 9月19日 | 10,279  | 29.4 | 1,667.88  | 26.6 | 99.2      | 0.7       |

(注 1) 騰落率は期首比。

(注 2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

## 《運用経過》

## ◆基準価額等の推移について

## 【基準価額・騰落率】

期首：7,944円 期末：10,279円 騰落率：29.4%

## 【基準価額の主な変動要因】

T O P I Xが上昇したことを受けて、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

## ◆投資環境について

## ○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、日米の金融政策や米国大統領選挙に関する見方が交錯し、一進一退で推移しました。2016年11月は、米国大統領選挙でのトランプ氏勝利を受けて一時的に投資家のリスク回避姿勢が強まり株価は下落しましたが、その後はトランプ氏の景気刺激政策への期待から、上昇基調となりました。12月半ば以降は、株価の急上昇に対する警戒感に加えてトランプ氏の政策に対する期待と不透明感が交錯し、一進一退で推移しました。2017年4月に入ると、北朝鮮の地政学リスクの高まりが懸念され、株価は下落しました。しかし4月後半からは、地政学リスク悪化の一巡に加えて、フランス大統領選挙で中道派のマクロン氏が極右政党の候補者を抑えて当選したことが好感されて、株価は上昇しました。6月以降は、欧米の中央銀行の金融引き締めペースの見方が交錯し、株価は横ばい圏で推移しました。8月に入ると、再び北朝鮮に関わる地政学リスクが高まったことや、米国物価統計の弱含みにより米国の年内利上げ観測が後退したこと、また対米ドルでの円高が進行したことなどが影響し、株価は軟調に推移しました。期末にかけては、北朝鮮の地政学リスクがやや後退したことや、衆議院解散観測を受けての安倍政権に対する期待の高まりから上昇しました。

## ◆前期における「今後の運用方針」

当ファンドの運用の基本方針に基づき、T O P I Xに連動する投資成果をめざして運用を行なっております。

## ◆ポートフォリオについて

株式を中心に、一部T O P I X先物取引も利用し、株式組入比率(株式先物を含む。)につきましては、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T O P I X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の手法)を用いて構築しています。

期中、資金変動への対応、新規上場等のT O P I Xの構成の変化への対応のため、随時、株式の売買を行ないました。

## ◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク(T O P I X)の騰落率は26.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は29.4%となりました。

- ・保有している株式の配当金について、ベンチマークが配当落ちしていることに対して、ファンドには配当金が計上されているため、ベンチマークと乖離しました。
- ・その他、ファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの騰落率とT O P I Xの騰落率との差異、先物取引の影響、売買コスト等がかい離の要因として挙げられます。

## 《今後の運用方針》

引き続き、当ファンドの運用の基本方針に基づき、T O P I Xに連動する投資成果をめざして運用を行なっております。

■ 1 万口当りの費用の明細

| 項 目             | 当 期        |
|-----------------|------------|
| 売買委託手数料<br>(株式) | 0円<br>( 0) |
| (先物)            | ( 0)       |
| 有価証券取引税         | —          |
| その他費用<br>(その他)  | 0<br>( 0)  |
| 合 計             | 0          |

(注 1) 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、簡便法により算出した結果です。費用の項  
目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の項目の概  
要をご参照ください。

(注 2) 各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

(2016 年 9 月 21 日から 2017 年 9 月 19 日まで)

|    | 買 付                           |                         | 売 付              |                  |
|----|-------------------------------|-------------------------|------------------|------------------|
|    | 株 数                           | 金 額                     | 株 数              | 金 額              |
| 国内 | 千株<br>5,578.4<br>(△6,320.252) | 千円<br>5,982,369<br>( —) | 千株<br>12,227.149 | 千円<br>13,343,331 |

(注 1) 金額は受渡し代金。

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

(注 3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種別別取引状況

(2016 年 9 月 21 日から 2017 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<br>16,503 | 百万円<br>16,006 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

(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

(2016 年 9 月 21 日から 2017 年 9 月 19 日まで)

| 当 期           |       |         |        | 期                |       |         |       |
|---------------|-------|---------|--------|------------------|-------|---------|-------|
| 買 付           |       |         |        | 売 付              |       |         |       |
| 銘 柄           | 株 数   | 金 額     | 平均単価   | 銘 柄              | 株 数   | 金 額     | 平均単価  |
|               | 千株    | 千円      | 円      |                  | 千株    | 千円      | 円     |
| 九州旅客鉄道        | 58.5  | 183,312 | 3,133  | ソフトバンクグループ       | 80.1  | 550,358 | 6,870 |
| 日本電信電話        | 27.6  | 130,017 | 4,710  | トヨタ自動車           | 68.5  | 449,238 | 6,558 |
| デンソー          | 19.3  | 89,341  | 4,629  | 東芝               | 1,327 | 321,329 | 242   |
| 東日本旅客鉄道       | 9.3   | 88,206  | 9,484  | 三菱 UFJ フィナンシャル G | 480.6 | 304,495 | 633   |
| 日本電産          | 6.8   | 70,031  | 10,298 | みずほフィナンシャル G     | 789.5 | 153,174 | 194   |
| 野村ホールディングス    | 111.5 | 61,111  | 548    | 日産自動車            | 141.6 | 151,756 | 1,071 |
| クボタ           | 27.7  | 52,652  | 1,900  | アステラス製薬          | 94.8  | 142,815 | 1,506 |
| ホシザキ          | 5.4   | 51,871  | 9,605  | 日本電信電話           | 28.7  | 140,491 | 4,895 |
| キャノン          | 15.1  | 49,765  | 3,295  | 武田薬品             | 25.9  | 128,685 | 4,968 |
| リクルートホールディングス | 12.5  | 47,352  | 3,788  | 花王               | 19.8  | 126,810 | 6,404 |

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 金額の単位未満は切捨て。



## ■組入資産明細表

## (1) 国内株式

| 銘柄            | 期 首   | 当 期 末     |         | 銘柄          | 期 首       | 当 期 末 |           | 銘柄            | 期 首   | 当 期 末     |           |
|---------------|-------|-----------|---------|-------------|-----------|-------|-----------|---------------|-------|-----------|-----------|
|               | 株 数   | 株 数 評 価 額 | 株 数     |             | 株 数 評 価 額 | 株 数   | 株 数 評 価 額 |               | 株 数   | 株 数 評 価 額 |           |
| 千株 千株 千円      |       |           |         | 千株 千株 千円    |           |       |           | 千株 千株 千円      |       |           |           |
| 水産・農林業 (0.1%) |       |           |         | 東洋建設        |           |       |           | カルビー          |       |           |           |
| 極洋            | 35    | 3.6       | 12,024  | 22.4        | 17.5      | 8,522 |           | 24.1          | 25.8  | 100,878   |           |
| 日本水産          | 77.9  | 82.7      | 50,943  | 5洋建設        | 73.1      | 69.4  | 44,971    | 森永乳業          | 59    | 58        | 50,054    |
| マルハニチロ        | 14    | 12        | 39,780  | 大林道路        | 9.1       | —     |           | 六甲パター         | 4     | 3.5       | 8,403     |
| カネコ種苗         | —     | 4.4       | 6,661   | 世紀東急        | 13.3      | 13.8  | 8,735     | ヤクルト          | 35.3  | 34        | 275,400   |
| サカタのタネ        | 10.7  | 9.7       | 30,749  | 福田組         | 12        | 2.2   | 13,376    | 明治ホールディングス    | 39.4  | 37.2      | 325,128   |
| ホクト           | 7     | 5.8       | 11,263  | 住友林業        | 44.6      | 42.1  | 70,643    | 雪印メグミルク       | 15.7  | 13.8      | 44,298    |
| 鉱業 (0.3%)     |       |           |         | 日本基礎技術      | 26.2      | 14.2  | 5,367     | プリマハム         | 46    | 44        | 34,188    |
| 日鉄鉱業          | 20    | 1.9       | 15,390  | 日成ビルド工業     | 22        | 21    | 12,600    | 日本ハム          | 47    | 45        | 141,525   |
| 三井鉱山          | 57    | 6.1       | 8,936   | パナホーム       | 25        | —     | —         | 丸大食品          | 36    | 29        | 15,805    |
| 国際石油開発帝石      | 338.9 | 327.6     | 364,127 | 大和ハウス       | 193       | 185.5 | 713,989   | S F o o d s   | 4.6   | 3.9       | 16,614    |
| 日本海洋掘削        | 2.5   | 3.3       | 6,860   | ライト工業       | 13.4      | 12.1  | 13,382    | 伊藤ハム米久 HLDGS  | 41.9  | 36.2      | 37,648    |
| 石油資源開発        | 10.2  | 9.2       | 20,332  | 積水ハウス       | 217.3     | 189.8 | 354,071   | サッポロホールディングス  | 20.2  | 20.3      | 64,757    |
| K&O エナジーグループ  | 5.1   | 4.1       | 7,605   | 日特建設        | 18.6      | —     | —         | アサヒグループホールディン | 122.7 | 117.7     | 539,536   |
| 建設業 (3.2%)    |       |           |         | ユアテック       | 12        | 11    | 8,855     | キリンHD         | 281   | 269.9     | 683,116   |
| ショーボンドHD      | 6.8   | 5.9       | 37,465  | 西部電気工業      | —         | 3.3   | 8,045     | 宝ホールディングス     | 47.3  | 45.5      | 48,412    |
| ミライト・ホールディングス | 20.4  | 18.9      | 24,796  | 中電工         | 7.5       | 6.3   | 19,309    | オエノンホールディングス  | 60    | 32.6      | 9,225     |
| タマホーム         | —     | 10.5      | 7,528   | 関電工         | 26        | 26    | 30,654    | コカ・コーラボトラーズJ  | 22.1  | 39.5      | 148,915   |
| 安藤・間          | 44.7  | 47.5      | 35,530  | きんでん        | 35.1      | 42.4  | 74,200    | コカ・コーリーストジャパン | 23.2  | —         | —         |
| 東急建設          | 22    | 23.1      | 20,397  | 東京エネシス      | 8         | 6.7   | 7,865     | サントリー食品インター   | 45.5  | 43        | 223,600   |
| コムシホールディングス   | 27.1  | 23.8      | 60,499  | トーエネック      | 11        | 9     | 5,823     | グایدールグループHD  | 3.4   | 2.7       | 14,580    |
| ミサワホーム        | 8.9   | 9.3       | 8,723   | 住友電設        | 6         | 4.8   | 9,681     | 伊藤園           | 19.3  | 18.6      | 71,331    |
| 高松コンストラクショング  | 4.8   | 4.4       | 13,332  | 日本電設工業      | 9.9       | 9.5   | 21,508    | キーコーヒー        | 6.7   | 5.6       | 12,443    |
| 東建コーポレーション    | 2.8   | 2.5       | 33,625  | 協和エクシオ      | 25.3      | 24.1  | 50,393    | 日清オイログループ     | 36    | 36        | 26,820    |
| 大成建設          | 340   | 319       | 373,868 | 九電工         | 12.2      | 12.6  | 55,125    | 不二製油グループ      | 17.5  | 17        | 51,595    |
| 大林組           | 196   | 188.9     | 245,570 | 三機工業        | 14.3      | 14.1  | 17,554    | J - オイルミルズ    | 32    | 2.6       | 10,517    |
| 清水建設          | 199   | 193.6     | 232,126 | 日揮          | 65        | 58.4  | 101,148   | キッコーマン        | 49    | 43.1      | 151,496   |
| 飛鳥建設          | 62    | 71.9      | 11,360  | 中外炉工業       | 34        | 32    | 7,008     | 味の素           | 138.1 | 129.3     | 280,516   |
| 長谷工コーポレーション   | 76.8  | 73.1      | 103,144 | 太平電業        | 10        | 9     | 12,834    | キューピー         | 33.9  | 32        | 85,152    |
| 松井建設          | 10.3  | 8.3       | 8,026   | 高砂熱学        | 18.6      | 17.3  | 32,420    | ハウス食品G本社      | 21.9  | 23        | 80,845    |
| 銭高組           | 18    | —         | —       | 明星工業        | 13.9      | 13.3  | 10,001    | カゴメ           | 23.1  | 22.4      | 77,504    |
| 鹿島建設          | 306   | 277       | 287,526 | 大気社         | 7.4       | 7.5   | 21,832    | アリアケジャパン      | 5.6   | 5.3       | 43,566    |
| 不動テトラ         | 51.3  | 54.3      | 9,882   | ダイダン        | 10        | 10    | 13,530    | ニチレイ          | 71    | 29.9      | 86,411    |
| 鉄建建設          | 43    | 40        | 14,320  | 日比谷総合設備     | 8.6       | 6.3   | 15,025    | 東洋水産          | 31.5  | 30.3      | 126,048   |
| 西松建設          | 75    | 71        | 43,026  | 東芝プラントシステム  | 9.9       | 10.1  | 19,594    | 日清食品HD        | 27.2  | 24.5      | 171,990   |
| 三井住友建設        | 255.1 | 240.9     | 29,389  | O S J B H D | —         | 27.8  | 9,007     | 永谷園ホールディングス   | 8     | 8         | 10,504    |
| 大豊建設          | 27    | 25        | 12,750  | 東洋エンジニア     | 35        | 37    | 10,508    | フジッコ          | 6.9   | 6         | 16,410    |
| 前田建設          | 40    | 42        | 54,684  | 千代田化工建      | 47        | 44    | 26,928    | ロククフィールド      | 8.4   | 7         | 14,476    |
| ナカノフドー建設      | 15.2  | —         | —       | 新興プランテック    | 13.5      | 13.8  | 13,496    | 日本たばこ産業       | 361.7 | 347.1     | 1,291,212 |
| 奥村組           | 58    | 48        | 39,696  | 食料品 (4.5%)  |           |       |           | ケンコーマヨネーズ     | —     | 4         | 11,204    |
| 東鉄工業          | 8     | 7.8       | 28,353  | 日本製粉        | 43        | 17.4  | 30,693    | わらべや日洋HD      | 4.1   | 4.1       | 11,492    |
| 浅沼組           | 37    | 27        | 8,802   | 日清製粉G本社     | 71        | 67.2  | 131,644   | ユーグレナ         | 22.5  | 22.3      | 25,488    |
| 戸田建設          | 76    | 74        | 61,716  | 昭和産業        | 27        | 24    | 14,880    | ミヨシ油脂         | 95    | 6.7       | 9,668     |
| 熊谷組           | 97    | 103       | 34,711  | 中部飼料        | 8.5       | 7.7   | 15,684    | 理研ビタミン        | —     | 1.9       | 8,255     |
| 北野建設          | 33    | 20        | 8,840   | フィード・ワン     | 54.7      | 49.9  | 12,874    | 繊維製品 (0.7%)   |       |           |           |
| 三井ホーム         | 13    | 11        | 7,865   | 日本甜菜糖       | 49        | 3.6   | 8,773     | 片倉工業          | 8.9   | 7.5       | 9,997     |
| 矢作建設          | 10.1  | 10        | 9,640   | 三井製糖        | 28        | 4.6   | 17,480    | グンゼ           | 49    | 46        | 24,610    |
| ピーエス三菱        | 20.3  | 14.7      | 8,981   | 塩水港精糖       | —         | 29.9  | 7,534     | 東洋紡           | 244   | 231       | 45,969    |
| 日本ハウス HLDGS   | 27.2  | 17.9      | 10,185  | 日新製糖        | —         | 3.1   | 6,215     | ユニチカ          | 233   | 186       | 15,438    |
| 大東建託          | 24.4  | 22.7      | 444,806 | 森永製菓        | 61        | 12.7  | 82,550    | 富士紡ホールディングス   | 37    | 3.3       | 12,408    |
| 新日本建設         | 10.7  | 8.6       | 7,275   | 中村屋         | 23        | 1.9   | 9,633     | 倉敷紡績          | 58    | 60        | 17,580    |
| N I P P O     | 15    | 13        | 29,666  | 江崎グリコ       | 15.1      | 15.9  | 89,835    | キッポウ          | 121   | 69        | 11,040    |
| 東亜道路          | 27    | 17        | 7,089   | 不二家         | 51        | 4.4   | 10,846    | 日本毛織          | 18.6  | 15.5      | 15,376    |
| 前田道路          | 19    | 19        | 43,206  | 山崎製パン       | 48.4      | 45.6  | 93,662    | グアードリミテツド     | 14.7  | 20.8      | 9,152     |
| 日本道路          | 20    | 20        | 12,280  | 第一屋製パン      | 44        | —     | —         | 帝国繊維          | 7     | 6.6       | 15,318    |
| 東亜建設          | 61    | 5.8       | 12,255  | モロゾフ        | 21        | 1.4   | 10,892    | 帝人            | 248   | 46.8      | 107,218   |
| 若築建設          | 92    | 53        | 10,176  | 亀田製菓        | 3.9       | 3.6   | 17,532    | 東レ            | 439   | 423.5     | 459,709   |
|               |       |           |         | 寿スピリッツ      | 5.7       | 6.4   | 23,712    | サカイ オーベックス    | 58    | 3.8       | 8,987     |

## トピックス・インデックス・マザーファンド

| 銘柄                  | 期首   |       | 当期末       |    | 銘柄             | 期首    |       | 当期末     |    | 銘柄                | 期首    |       | 当期末       |    |
|---------------------|------|-------|-----------|----|----------------|-------|-------|---------|----|-------------------|-------|-------|-----------|----|
|                     | 株数   | 千株    | 株数        | 千株 |                | 株数    | 千株    | 株数      | 千株 |                   | 株数    | 千株    | 株数        | 千株 |
| 住江織物                | 37   | 22    | 7,590     | —  | 大日精化           | 24    | 24    | 26,256  | —  | 星光PMC             | 5.6   | 4.4   | 5,319     | —  |
| 芦森工業                | 47   | —     | —         | —  | カネカ            | 82    | 76    | 66,044  | —  | 小林製薬              | 18.2  | 15.9  | 105,417   | —  |
| アツギ                 | 89   | 76    | 9,652     | —  | 三菱瓦斯化学         | 102   | 54.9  | 150,426 | —  | 荒川化学工業            | 6.2   | 5.6   | 15,388    | —  |
| セーレン                | 16.1 | 15.5  | 31,666    | —  | 三井化学           | 259   | 265   | 184,175 | —  | メック               | —     | 6.3   | 11,642    | —  |
| ソトー                 | —    | 6.8   | 7,874     | —  | J S R          | 56.8  | 58.4  | 126,319 | —  | 日本高純度化学           | 3.1   | 4.3   | 11,820    | —  |
| 東海染工                | —    | 51    | 7,191     | —  | 東京応化工業         | 12.2  | 10.9  | 45,235  | —  | タカラバイオ            | 12.2  | 17.1  | 26,111    | —  |
| 小松精練                | 13.2 | 10.6  | 9,497     | —  | 大阪有機化学         | —     | 6.6   | 9,266   | —  | J C U             | 2.3   | 4.3   | 21,134    | —  |
| ワコールホールディングス        | 33   | 33    | 53,526    | —  | 三菱ケミカル HLDGS   | 403.1 | 395.1 | 427,300 | —  | 新田ゼラチン            | 6.9   | 8.2   | 6,199     | —  |
| ホギメディカル             | 3.8  | 3.6   | 29,520    | —  | 日本合成化学         | 15    | —     | —       | —  | デクセリアルズ           | 17.8  | 16    | 23,664    | —  |
| T S Iホールディングス       | 27.6 | 25.4  | 20,980    | —  | ダイセル           | 84.3  | 78.8  | 108,901 | —  | アース製薬             | 4.5   | 4.3   | 22,059    | —  |
| 三陽商会                | 37   | 4.4   | 7,233     | —  | 住友ベークライト       | 56    | 51    | 42,585  | —  | イハラケミカル           | 10.3  | —     | —         | —  |
| オンワードホールディングス       | 36   | 37    | 30,858    | —  | 積水化学           | 136   | 129.3 | 284,330 | —  | 北興化学              | —     | 12.9  | 8,991     | —  |
| ゴールドウイン             | 2.8  | 2.6   | 19,760    | —  | 日本ゼオン          | 51    | 50    | 72,500  | —  | 大成ラミック            | 2.8   | 3.3   | 9,784     | —  |
| デサント                | 14.4 | 13.5  | 19,683    | —  | アイカ工業          | 17.6  | 18.2  | 67,067  | —  | クマイ化学             | 13.5  | 26.3  | 20,540    | —  |
| <b>パルプ・紙 (0.2%)</b> |      |       |           |    | 宇部興産           | 327   | 295   | 98,235  | —  | 日本農薬              | 15.1  | 15.6  | 10,155    | —  |
| 特種東海製紙              | 38   | 3.1   | 14,198    | —  | 積水樹脂           | 8.7   | 8.4   | 17,774  | —  | アキレス              | 63    | 5.1   | 11,541    | —  |
| 王子ホールディングス          | 229  | 223   | 132,685   | —  | タキロンシーアイ       | 17    | 13    | 8,853   | —  | 有沢製作所             | 11.1  | 12.7  | 13,106    | —  |
| 日本製紙                | 31.2 | 25.6  | 53,196    | —  | 旭有機材           | 32    | 31    | 9,083   | —  | 日東電工              | 47.4  | 42.2  | 412,083   | —  |
| 三菱製紙                | 111  | 11.2  | 8,366     | —  | 日立化成           | 29.5  | 32.4  | 104,976 | —  | レック               | —     | 4.5   | 13,342    | —  |
| 北越紀州製紙              | 39.5 | 32.9  | 22,766    | —  | ニチパン           | 9     | 7     | 8,057   | —  | きもと               | —     | 22.5  | 5,512     | —  |
| 中越パルプ               | 30   | 26    | 5,902     | —  | リケンテクノス        | 13.5  | 13.6  | 8,880   | —  | 藤森工業              | 5.5   | 4.9   | 18,571    | —  |
| 巴川製紙                | —    | 24    | 8,280     | —  | 大倉工業           | 20    | 18    | 14,490  | —  | 前澤化成工業            | 7.4   | 8.7   | 10,848    | —  |
| 大王製紙                | 27.2 | 23    | 30,590    | —  | 積水化成成品         | 18    | 8.9   | 11,409  | —  | ジェイエスピー           | 4.3   | 3     | 10,230    | —  |
| レンゴー                | 53   | 53.4  | 34,176    | —  | 群栄化学           | 21    | 1.9   | 7,049   | —  | エフビコ              | 5.3   | 5.3   | 29,733    | —  |
| トーモク                | 24   | 19    | 7,448     | —  | タイガース ポリマー     | —     | 6.2   | 4,885   | —  | 天馬                | 5.4   | 3.7   | 8,487     | —  |
| ザ・バック               | 4.7  | 4.4   | 17,644    | —  | ダイキョーニシカワ      | 8.6   | 10.4  | 18,075  | —  | 信越ポリマー            | 14.3  | 12.5  | 12,787    | —  |
| <b>化学 (7.2%)</b>    |      |       |           |    | 日本化薬           | 40    | 37    | 67,192  | —  | 東リ                | 22    | 23.6  | 9,510     | —  |
| クラレ                 | 94.8 | 98    | 208,544   | —  | カーリットホールディングス  | 10.2  | 16.1  | 11,930  | —  | ニフコ               | 11.6  | 10.1  | 69,488    | —  |
| 旭化成                 | 378  | 365   | 510,635   | —  | 日本精化           | 7.9   | 8.3   | 7,851   | —  | 日本バルカー            | 33    | 5.4   | 15,530    | —  |
| 共和レザー               | 6.3  | 6.2   | 5,834     | —  | 扶桑化学工業         | —     | 4.8   | 16,944  | —  | ユニ・チャーム           | 124   | 118.7 | 308,857   | —  |
| 昭和電工                | 40.8 | 39.8  | 133,927   | —  | A D E K A      | 27.8  | 22.8  | 44,642  | —  | <b>医薬品 (4.5%)</b> |       |       |           |    |
| 住友化学                | 445  | 430   | 304,010   | —  | 日油             | 46    | 45    | 73,215  | —  | 協和発酵キリン           | 73    | 70    | 130,480   | —  |
| 住友精化                | 14   | 2.6   | 13,598    | —  | 花王             | 155   | 137.6 | 941,734 | —  | 武田薬品              | 241.9 | 219.7 | 1,360,162 | —  |
| 日産化学                | 36.7 | 31.7  | 129,336   | —  | 第一工業製薬         | 25    | 19    | 12,958  | —  | アステラス製薬           | 662.5 | 572.7 | 839,578   | —  |
| ラサ工業                | 41   | 57    | 12,027    | —  | 三洋化成           | 20    | 3.2   | 20,384  | —  | 大日本住友製薬           | 43.8  | 40.3  | 59,603    | —  |
| クレハ                 | 45   | 4.3   | 24,725    | —  | 大日本塗料          | 43    | 37    | 12,802  | —  | 塩野義製薬             | 89.3  | 74.3  | 442,753   | —  |
| テイカ                 | 14   | 11    | 11,308    | —  | 日本ペイント HOLD    | 47.2  | 45.7  | 178,687 | —  | 田辺三菱製薬            | 69.8  | 68.5  | 185,429   | —  |
| 石原産業                | 120  | 11.6  | 17,980    | —  | 関西ペイント         | 67.9  | 61.6  | 173,835 | —  | あすか製薬             | 9.4   | 6.7   | 11,591    | —  |
| 日東エフシー              | 5.8  | 6     | 5,268     | —  | 中国塗料           | 18    | 15.8  | 14,694  | —  | 日本新薬              | 14.1  | 13.7  | 108,915   | —  |
| 日本曹達                | 41   | 35    | 23,520    | —  | 日本特殊塗料         | 6.2   | 5     | 9,620   | —  | 中外製薬              | 61.4  | 59    | 274,940   | —  |
| 東ソー                 | 164  | 171   | 221,616   | —  | 藤倉化成           | 14.5  | 9.8   | 6,458   | —  | 科研製薬              | 10.5  | 10.9  | 63,547    | —  |
| トクヤマ                | 110  | 94    | 48,786    | —  | 太陽ホールディングス     | 4.6   | 4.8   | 25,824  | —  | エーザイ              | 75.3  | 72.2  | 423,741   | —  |
| セントラル硝子             | 66   | 57    | 28,842    | —  | D I C          | 23.7  | 23    | 92,000  | —  | ロート製薬             | 30.3  | 28.9  | 76,007    | —  |
| 東亞合成                | 37.2 | 33.2  | 48,339    | —  | サカタインクス        | 12.9  | 12.4  | 25,320  | —  | 小野薬品              | 140   | 133.4 | 324,162   | —  |
| 大阪ソーダ               | 28   | 25    | 14,325    | —  | 東洋インキSCホールディング | 57    | 47    | 29,986  | —  | 久光製薬              | 18.9  | 16.4  | 87,740    | —  |
| 関東電化                | 16   | 12.6  | 14,338    | —  | T & K T O K A  | 6.2   | 5.3   | 6,794   | —  | 持田製薬              | 4.3   | 3.6   | 30,240    | —  |
| デンカ                 | 127  | 111   | 81,363    | —  | 富士フイルム HLDGS   | 139   | 114.8 | 503,168 | —  | 参天製薬              | 111.6 | 105.8 | 190,757   | —  |
| 信越化学                | 109  | 105.3 | 1,069,848 | —  | 資生堂            | 116.9 | 105.1 | 482,409 | —  | 扶桑薬品              | 28    | 2.7   | 7,487     | —  |
| 日本カーバイド             | 85   | 36    | 8,604     | —  | ライオン           | 71    | 78.9  | 171,055 | —  | 日本ケミファ            | 13    | 1.6   | 8,144     | —  |
| 堺化学                 | 28   | 20    | 11,020    | —  | 高砂香料           | 4.3   | 4     | 15,360  | —  | ツムラ               | 19.3  | 20.1  | 80,701    | —  |
| エア・ウォーター            | 49   | 46.8  | 96,408    | —  | マンダム           | 5.8   | 5.8   | 36,888  | —  | 日医工               | 14.6  | 13.6  | 23,052    | —  |
| 大陽日酸                | 45.9 | 44.5  | 57,138    | —  | ミルボン           | 3.9   | 4.1   | 27,470  | —  | キッセイ薬品工業          | 10.1  | 10.2  | 29,314    | —  |
| 日本化学工業              | 32   | 31    | 8,308     | —  | ファンケル          | 14.2  | 13.2  | 32,089  | —  | 生化学工業             | 12.4  | 10.9  | 21,353    | —  |
| 日本パーカラライジング         | 29.3 | 29.6  | 51,800    | —  | コーセー           | 9.9   | 9.6   | 131,232 | —  | 栄研化学              | 6     | 5.2   | 21,580    | —  |
| 高圧ガス                | 12   | 9.2   | 7,764     | —  | シーズ・ホールディングス   | 8.4   | 8.1   | 31,185  | —  | 日水製薬              | —     | 4.2   | 5,959     | —  |
| 四国化成                | 10   | 9     | 14,715    | —  | ポーラ・オルビス HD    | 6.2   | 24.8  | 86,924  | —  | 鳥居薬品              | 4.7   | 3.9   | 11,544    | —  |
| 戸田工業                | —    | 17    | 8,891     | —  | ノエビアホールディングス   | 4.1   | 4.2   | 26,838  | —  | J C Rファーマ         | 5.4   | 4.8   | 14,688    | —  |
| ステラ ケミファ            | 4.4  | 3.1   | 15,655    | —  | コニシ            | 10.6  | 9.5   | 18,971  | —  | 東和薬品              | 3     | 2.8   | 14,672    | —  |
| 保土谷化学               | 34   | 2.3   | 19,849    | —  | 長谷川香料          | 7.9   | 7.3   | 15,789  | —  | 富士製薬工業            | 2.7   | 2.7   | 10,597    | —  |
| 日本触媒                | 8.8  | 9.1   | 74,529    | —  |                |       |       |         |    |                   |       |       |           |    |



| 銘柄                     | 期首    |       | 当期末     |       | 銘柄                 | 期首    |       | 当期末     |       | 銘柄               | 期首    |       | 当期末     |       |
|------------------------|-------|-------|---------|-------|--------------------|-------|-------|---------|-------|------------------|-------|-------|---------|-------|
|                        | 株数    | 千株    | 株数      | 千株    |                    | 株数    | 千株    | 株数      | 千株    |                  | 株数    | 千株    | 株数      | 千株    |
| 沢井製薬                   | 10.4  | 9.6   | 59,328  | 59.3  | 中山製鋼所              | —     | 6.4   | 4,742   | 4.7   | ノーリツ             | 11.8  | 11.9  | 23,383  | 23.4  |
| ゼリア新薬工業                | 13.1  | 12.5  | 25,287  | 12.5  | 合同製鐵               | 41    | 3.9   | 8,303   | 3.9   | 長府製作所            | 5.9   | 5.7   | 15,390  | 15.4  |
| 第一三共                   | 205.9 | 171.8 | 448,398 | 171.8 | J F Eホールディングス      | 164.7 | 159.8 | 357,232 | 159.8 | リンナイ             | 11.2  | 10    | 97,000  | 97.0  |
| キョーリン製薬HD              | 16.1  | 13.6  | 30,504  | 13.6  | 日新製鋼               | 27.3  | 18.2  | 25,862  | 18.2  | 岡部               | 13.7  | 11.6  | 11,901  | 11.9  |
| 大幸薬品                   | 4.6   | 4.5   | 10,242  | 4.5   | 東京製鐵               | 33.8  | 31.7  | 31,002  | 31.7  | ジーテクト            | 7.3   | 6.1   | 13,548  | 13.5  |
| ダイト                    | 3.9   | 3.9   | 11,220  | 3.9   | 共英製鋼               | 7.1   | 6.6   | 11,081  | 6.6   | 東ブレ              | 12.2  | 10.9  | 36,460  | 36.5  |
| 大塚ホールディングス             | 131.7 | 116.3 | 509,161 | 116.3 | 大和工業               | 13.3  | 11.3  | 35,990  | 11.3  | 高周波熱練            | 12.8  | 11.2  | 12,544  | 12.5  |
| 大正製薬HD                 | 14.5  | 12.1  | 105,149 | 12.1  | 東京製鋼               | 24    | 18    | 7,830   | 18    | 東京製鋼             | 49    | 4.8   | 7,987   | 4.8   |
| ペプチドリーム                | 10.3  | 22.5  | 79,312  | 22.5  | 大阪製鐵               | 4.2   | 3.6   | 8,985   | 3.6   | パイオラックス          | 3.3   | 9.5   | 27,502  | 27.5  |
| <b>石油・石化製品 (0.6%)</b>  |       |       |         |       | 淀川製鋼所              | 9.3   | 7.6   | 23,446  | 7.6   | 日本発条             | 53.3  | 52.9  | 62,686  | 62.7  |
| 日本コークス工業               | 64.2  | 65.3  | 7,313   | 65.3  | 東洋鋼板               | 17.3  | 16    | 8,720   | 16    | 三益半導体            | 5.5   | 5.8   | 10,393  | 10.4  |
| 昭和シエル石油                | 57.8  | 51.5  | 62,881  | 51.5  | 丸一鋼管               | 20.1  | 18.7  | 61,616  | 18.7  | <b>機械 (5.4%)</b> |       |       |         |       |
| ニチレキ                   | 9     | 9.2   | 12,594  | 9.2   | 大同特殊鋼              | 101   | 99    | 64,845  | 99    | 日本製鋼所            | 102   | 19    | 49,685  | 49.7  |
| 東燃ゼネラル石油               | 90    | —     | —       | —     | 日本高周波              | 64    | 64    | 7,360   | 64    | 三浦工業             | 27.2  | 23.9  | 62,665  | 62.7  |
| ユシロ化学                  | 4.8   | 4.7   | 7,675   | 4.7   | 日本冶金工              | 72.8  | 56.8  | 12,836  | 56.8  | タクマ              | 23    | 19.7  | 26,831  | 26.8  |
| ビービー・カストロール            | 4.3   | —     | —       | —     | 山陽特殊製鋼             | 38    | 36    | 20,700  | 36    | ツガミ              | 20    | 18    | 18,324  | 18.3  |
| 富士石油                   | 19.5  | 18.9  | 7,938   | 18.9  | 愛知製鋼               | 38    | 3     | 13,290  | 3     | オークマ             | 40    | 38    | 42,788  | 42.8  |
| MORESCO                | —     | 4.2   | 9,042   | 4.2   | 日立金属               | 68.7  | 59.8  | 92,570  | 59.8  | 東芝機械             | 34    | 31    | 18,724  | 18.7  |
| 出光興産                   | 31.2  | 36.5  | 104,937 | 36.5  | 大平洋金属              | 48    | 43    | 13,416  | 43    | アマダホールディングス      | 85.8  | 77.2  | 95,882  | 95.9  |
| JXTGホールディングス           | 712.9 | 889.3 | 503,077 | 889.3 | 新日本電工              | 40.4  | 37.5  | 17,700  | 37.5  | アイダエンジニア         | 16.9  | 16.1  | 20,930  | 20.9  |
| コスモエネルギーHDGS           | 18.6  | 17.7  | 42,462  | 17.7  | 栗本鉄工所              | 35    | 3.1   | 7,232   | 3.1   | 滝澤鉄工所            | 81    | 56    | 11,256  | 11.3  |
| <b>ゴム製品 (1.0%)</b>     |       |       |         |       | 日本鉄鉄管              | —     | 25    | 4,525   | 25    | 富士機械製造           | 17.9  | 18.5  | 38,535  | 38.6  |
| 横浜ゴム                   | 36.4  | 32.5  | 72,962  | 32.5  | 三菱製鋼               | 47    | 46    | 13,386  | 46    | 牧野フライス           | 31    | 30    | 28,950  | 28.9  |
| 東洋ゴム                   | 27.5  | 33.8  | 80,883  | 33.8  | シンニタン              | —     | 8.8   | 6,520   | 8.8   | オーエスジー           | 27.4  | 24.4  | 60,878  | 60.9  |
| ブリヂストン                 | 206.1 | 197.7 | 993,442 | 197.7 | <b>非鉄金属 (1.0%)</b> |       |       |         |       | 旭ダイヤモンド          | 17.2  | 16.7  | 18,904  | 18.9  |
| 住友ゴム                   | 55.8  | 54.4  | 107,984 | 54.4  | 大紀アルミニウム           | —     | 15    | 12,270  | 15    | DMG森精機           | 33.9  | 30.9  | 59,946  | 59.9  |
| 藤倉ゴム                   | —     | 10.7  | 10,079  | 10.7  | 日本軽金属HD            | 145.9 | 146.2 | 48,392  | 146.2 | ソディック            | 15.3  | 16.6  | 23,389  | 23.4  |
| オカモト                   | 20    | 19    | 22,287  | 19    | 三井金属               | 161   | 163   | 97,148  | 163   | ディスコ             | 7.7   | 7     | 162,400 | 162.4 |
| ニッタ                    | 5.9   | 5     | 20,175  | 5     | 東邦亜鉛               | 43    | 37    | 18,130  | 37    | 日東工器             | 4.1   | 3.4   | 9,302   | 9.3   |
| 住友理工                   | 13.3  | 9.4   | 10,321  | 9.4   | 三菱マテリアル            | 378   | 36.4  | 144,508 | 36.4  | OKK              | 42    | 59    | 7,788   | 7.8   |
| ミツ星ベルト                 | 16    | 14    | 18,830  | 14    | 住友鉱山               | 167   | 152   | 297,312 | 152   | 島精機製作所           | 8.8   | 8     | 43,200  | 43.2  |
| バンドー化学                 | 25    | 9.2   | 11,021  | 9.2   | DOWAホールディングス       | 80    | 64    | 52,672  | 64    | NCホールディングス       | 3.2   | —     | —       | —     |
| <b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b> |       |       |         |       | 古河機金               | 103   | 92    | 17,940  | 92    | フリーユ             | —     | 4.5   | 4,882   | 4.9   |
| 日東紡績                   | 43    | 48    | 31,344  | 48    | 大阪チタニウム            | 6.8   | 7.4   | 11,840  | 7.4   | 日阪製作所            | 9.4   | 9.3   | 9,151   | 9.2   |
| 旭硝子                    | 301   | 57.1  | 237,821 | 57.1  | 東邦チタニウム            | 11.9  | 11.5  | 9,338   | 11.5  | やまごこ             | 12.1  | 11.3  | 16,249  | 16.2  |
| 日本板硝子                  | 315   | 25.9  | 22,015  | 25.9  | UACJ               | 88    | 83    | 26,809  | 83    | ペガサスミシン製造        | —     | 9.6   | 7,238   | 7.2   |
| 日本山村硝子                 | 30    | 41    | 8,118   | 41    | 古河電工               | 194   | 19.9  | 125,171 | 19.9  | ナプテスコ            | 31.2  | 30    | 129,000 | 129.0 |
| 日本電気硝子                 | 123   | 24.3  | 103,275 | 24.3  | 住友電工               | 241.1 | 219.6 | 389,790 | 219.6 | 三井海洋開発           | 7.4   | 6.1   | 15,408  | 15.4  |
| 住友大阪セメント               | 123   | 109   | 54,500  | 109   | フジクラ               | 84    | 78    | 72,150  | 78    | レオン自動機           | —     | 6.9   | 9,784   | 9.8   |
| 太平洋セメント                | 379   | 356   | 156,284 | 356   | 昭和電線HLDGS          | 98    | 96    | 10,080  | 96    | S MC             | 18.2  | 17.6  | 705,760 | 705.8 |
| 日本ヒューム                 | 8.1   | 10.3  | 6,993   | 10.3  | タツタ電線              | 16.7  | 15    | 12,855  | 15    | 新川               | 11.5  | 8.2   | 6,314   | 6.3   |
| 日本コンクリート               | 23.9  | 17.5  | 7,752   | 17.5  | リョービ               | 39    | 34    | 20,468  | 34    | ホンカワミクロン         | 12    | 2.6   | 15,912  | 15.9  |
| アジアパイルHD               | 16.6  | 10.8  | 6,382   | 10.8  | アールステイ             | 9.4   | 8     | 7,312   | 8     | ユニオンツール          | 2.9   | 2.9   | 10,353  | 10.4  |
| 東海カーボン                 | 54    | 53    | 47,700  | 53    | アサヒHD              | 9.4   | 8.7   | 20,166  | 8.7   | オイルシ工業           | 7.7   | 6.6   | 13,477  | 13.5  |
| 日本カーボン                 | 36    | 3.3   | 13,860  | 3.3   | <b>金属製品 (0.7%)</b> |       |       |         |       | 日精エーエスピー         | 2.8   | —     | —       | —     |
| 東洋炭素                   | 4.1   | 4     | 10,744  | 4     | 稲葉製作所              | 4.5   | 4.3   | 6,032   | 4.3   | サトーホールディングス      | 8.4   | 7.7   | 20,674  | 20.7  |
| ノリタケ                   | 37    | 3.6   | 20,088  | 3.6   | 宮地エンジニアリングG        | 56    | 24    | 7,488   | 24    | 日精樹脂工業           | 7.2   | 6.5   | 9,288   | 9.3   |
| TOTO                   | 44.7  | 42.9  | 189,403 | 42.9  | トーカロ               | 5.3   | 4.3   | 18,619  | 4.3   | 小松製作所            | 299.1 | 270.6 | 857,260 | 857.3 |
| 日本碍子                   | 77    | 73.1  | 155,264 | 73.1  | SUMCO              | 48.8  | 52    | 88,816  | 52    | 住友重機械            | 176   | 170   | 151,810 | 151.8 |
| 日本特殊陶業                 | 51.9  | 50.2  | 111,695 | 50.2  | 川田テクノロジーズ          | 1.5   | 1.4   | 8,470   | 1.4   | 日立建機             | 26.7  | 26.2  | 84,757  | 84.8  |
| MARUWA                 | 2.8   | 2.4   | 15,216  | 2.4   | 東洋製罐ブルーパHD         | 41.1  | 39.3  | 75,023  | 39.3  | 巴工業              | 3.8   | 4.8   | 9,211   | 9.2   |
| 品川フラクトリーズ              | 27    | 16    | 5,904   | 16    | ホッカンホールディングス       | 20    | 18    | 7,596   | 18    | 井関農機             | 66    | 5.5   | 13,431  | 13.4  |
| 黒崎播磨                   | —     | 16    | 8,656   | 16    | 横河ブリッジHLDGS        | 12.4  | 10.5  | 22,123  | 10.5  | TOWA             | 8     | 5.6   | 9,878   | 9.9   |
| フジインコーポレーテッド           | 5.7   | 5.4   | 14,526  | 5.4   | 駒井ハルテック            | —     | 2.5   | 5,847   | 2.5   | 丸山製作所            | 27    | 4.6   | 8,303   | 8.3   |
| ニチアス                   | 31    | 32    | 42,560  | 32    | 三和ホールディングス         | 61.4  | 57.5  | 73,427  | 57.5  | 北川鉄工所            | 47    | 3.4   | 8,962   | 8.9   |
| ニチハ                    | 8.9   | 8.4   | 33,768  | 8.4   | 文化シャッター            | 18.2  | 15.9  | 14,310  | 15.9  | ローツェ             | —     | 3.3   | 7,758   | 7.8   |
| <b>鉄鋼 (1.3%)</b>       |       |       |         |       | 三協立山               | 8.3   | 8.4   | 13,003  | 8.4   | クボタ              | 293.8 | 301.6 | 607,422 | 607.5 |
| 新日鐵住金                  | 274.3 | 263.1 | 713,527 | 263.1 | アルインコ              | 6.8   | 6.4   | 8,230   | 6.4   | 三菱化工機            | 34    | 36    | 9,432   | 9.4   |
| 神戸製鋼所                  | 1,107 | 101.1 | 135,777 | 101.1 | LIXILグループ          | 83.2  | 82    | 250,510 | 82    | 月島機械             | 11.8  | 10.8  | 15,249  | 15.2  |

## トピックス・インデックス・マザーファンド

| 銘柄            | 期首    |       | 当期末     |         | 銘柄           | 期首    |       | 当期末       |           | 銘柄           | 期首    |       | 当期末       |           |
|---------------|-------|-------|---------|---------|--------------|-------|-------|-----------|-----------|--------------|-------|-------|-----------|-----------|
|               | 株数    | 千株    | 株数      | 千株      |              | 株数    | 千株    | 株数        | 千株        |              | 株数    | 千株    | 株数        | 千株        |
| 帝国電機製作所       | 8     | 6.6   | 7,840   | 7,840   | 三菱重工業        | 1,032 | 932   | 407,004   | 407,004   | 日立国際電気       | 14    | 14.7  | 43,717    | 43,717    |
| 新東工業          | 14.6  | 14.2  | 17,522  | 17,522  | I H I        | 446   | 432   | 166,320   | 166,320   | ソニー          | 412.5 | 395.2 | 1,696,988 | 1,696,988 |
| 渋谷工業          | 5.5   | 5.3   | 19,106  | 19,106  | スター精密        | —     | 10.1  | 19,200    | 19,200    | T D K        | 34.9  | 31.1  | 233,872   | 233,872   |
| アイチ コーポレーション  | 10    | 9.7   | 7,430   | 7,430   | 電気機器 (13.6%) |       |       |           |           | 帝国通信工業       | 46    | 30    | 6,900     | 6,900     |
| 小森コーポレーション    | 15.2  | 14.3  | 19,962  | 19,962  | 日清紡ホールディングス  | 30.2  | 28.1  | 37,288    | 37,288    | ミツミ電機        | 24.9  | —     | —         | —         |
| 鶴見製作所         | 5.1   | 4.9   | 10,113  | 10,113  | イビデン         | 36.1  | 39.1  | 70,966    | 70,966    | タムラ製作所       | 27    | 25    | 15,800    | 15,800    |
| 住友精密          | 21    | 19    | 6,669   | 6,669   | コニカミノルタ      | 144.5 | 129.2 | 120,156   | 120,156   | アルプス電気       | 50.7  | 51.8  | 157,213   | 157,213   |
| 荏原製作所         | 135   | 26.1  | 95,395  | 95,395  | ブラザー工業       | 73.9  | 68.8  | 181,219   | 181,219   | パイオニア        | 97.4  | 83.3  | 17,159    | 17,159    |
| 西島製作所         | 7.7   | 6.4   | 7,616   | 7,616   | ミネベアミツミ      | 94    | 103.3 | 196,166   | 196,166   | 日本電波工業       | 8.1   | 7.4   | 6,275     | 6,275     |
| 北越工業          | 14.3  | 10    | 10,850  | 10,850  | 日立           | 1,482 | 1,342 | 1,064,340 | 1,064,340 | 日本トリム        | 1.9   | 1.4   | 6,531     | 6,531     |
| ダイキン工業        | 85    | 76.3  | 863,334 | 863,334 | 東芝           | 1,240 | —     | —         | —         | ローランドディー・ジー  | 3.6   | 3.5   | 9,709     | 9,709     |
| オルガノ          | —     | 16    | 9,440   | 9,440   | 三菱電機         | 619   | 595   | 1,044,225 | 1,044,225 | フオスター電機      | 7.7   | 6.9   | 16,070    | 16,070    |
| トーヨーカネツ       | 42    | 31    | 12,090  | 12,090  | 富士電機         | 175   | 167   | 104,876   | 104,876   | クラリオン        | 34    | 31    | 13,578    | 13,578    |
| 栗田工業          | 35.2  | 31.3  | 101,725 | 101,725 | 東洋電機製造       | 38    | 3.8   | 8,987     | 8,987     | S M K        | 22    | 17    | 8,330     | 8,330     |
| 椿本チエイン        | 34    | 31    | 27,776  | 27,776  | 安川電機         | 72.2  | 65.2  | 235,372   | 235,372   | ヨコオ          | 8.1   | 6.3   | 9,128     | 9,128     |
| アネスト岩田        | 11.6  | 10.8  | 11,383  | 11,383  | シンフォニアテクノロジー | 47    | 42    | 21,294    | 21,294    | ホシデン         | 19.6  | 17.2  | 31,390    | 31,390    |
| ダイフク          | 31.2  | 28.3  | 157,914 | 157,914 | 明電舎          | 56    | 51    | 20,553    | 20,553    | ヒロセ電機        | 9.2   | 9     | 144,270   | 144,270   |
| 加藤製作所         | 21    | 3.6   | 11,952  | 11,952  | 山洋電気         | 17    | 16    | 21,536    | 21,536    | 日本航空電子       | 17    | 16    | 29,168    | 29,168    |
| 油研工業          | 54    | 36    | 9,180   | 9,180   | デンヨー         | 6.2   | 5.6   | 11,396    | 11,396    | T O A        | 7.9   | 7     | 8,470     | 8,470     |
| タダノ           | 28    | 29.8  | 39,783  | 39,783  | 東芝テック        | 43    | 35    | 21,875    | 21,875    | 日立マクセル       | 9.8   | 8.5   | 21,573    | 21,573    |
| フジテック         | 17    | 16.2  | 25,498  | 25,498  | 芝浦メカトロニクス    | —     | 19    | 6,669     | 6,669     | 古野電気         | 10.1  | 8.8   | 6,107     | 6,107     |
| C K D         | 17.3  | 17.4  | 37,879  | 37,879  | マブチモーター      | 16.6  | 15.4  | 84,700    | 84,700    | ユニデンホールディングス | 94    | 30    | 8,610     | 8,610     |
| キトー           | 9.3   | 8.1   | 10,440  | 10,440  | 日本電産         | 70.8  | 72.6  | 997,524   | 997,524   | アルパイン        | 14.4  | 14.1  | 29,328    | 29,328    |
| 平和            | 18    | 17.1  | 36,884  | 36,884  | 東光高岳         | 3.4   | 3.8   | 7,641     | 7,641     | スミダコーポレーション  | —     | 6.4   | 13,497    | 13,497    |
| 理想科学工業        | 6.7   | 5.5   | 11,313  | 11,313  | ダブル・スコープ     | 5.6   | 8.4   | 20,437    | 20,437    | アイコム         | 4.2   | 3.5   | 9,439     | 9,439     |
| S A N K Y O   | 15.3  | 14.3  | 50,121  | 50,121  | ダイヘン         | 35    | 32    | 31,552    | 31,552    | リオン          | —     | 3.4   | 7,803     | 7,803     |
| 日本金銭機械        | 6.7   | 6.5   | 7,462   | 7,462   | 田淵電機         | 16.2  | 16    | 4,592     | 4,592     | 船井電機         | 6.7   | 6.3   | 5,392     | 5,392     |
| マースエンジニアリング   | 3.9   | 3.5   | 8,088   | 8,088   | J V C ケンウッド  | 47.7  | 43.9  | 13,960    | 13,960    | 横河電機         | 58.7  | 60.3  | 113,786   | 113,786   |
| 福島工業          | 4.2   | 3.7   | 15,614  | 15,614  | 第一精工         | 3.8   | —     | —         | —         | 新元元工業        | 23    | 25    | 17,350    | 17,350    |
| ダイコク電機        | 3.4   | 3.3   | 5,517   | 5,517   | 日新電機         | 14.6  | 11.4  | 15,823    | 15,823    | アズビル         | 18.2  | 16.6  | 80,842    | 80,842    |
| 竹内製作所         | 12.2  | 10.7  | 24,545  | 24,545  | 大崎電気         | 12    | 12    | 10,032    | 10,032    | 日本光電工業       | 24.2  | 23    | 57,500    | 57,500    |
| アマノ           | 18    | 17.1  | 45,263  | 45,263  | オムロン         | 65.7  | 59.4  | 348,678   | 348,678   | 共和電業         | 13.7  | 16.8  | 7,123     | 7,123     |
| J U K I       | 10.4  | 8.9   | 14,070  | 14,070  | 日東工業         | 9.6   | 7.6   | 15,329    | 15,329    | 堀場製作所        | 10.7  | 10.8  | 69,876    | 69,876    |
| サンデンホールディングス  | 37    | 41    | 17,630  | 17,630  | I D E C      | 9.3   | 9.6   | 22,473    | 22,473    | アドバンテス       | 40.3  | 38.6  | 81,716    | 81,716    |
| 蛇の目マシン        | 12    | 7.5   | 5,737   | 5,737   | ジーエス・ユアサ コーポ | 114   | 106   | 61,692    | 61,692    | エスベック        | 7.1   | 5.6   | 12,454    | 12,454    |
| マックス          | 10    | 10    | 15,400  | 15,400  | サクサホールディングス  | —     | 28    | 5,964     | 5,964     | パナソニックデバイス   | 8.3   | —     | —         | —         |
| グローリー         | 19.7  | 17.1  | 68,058  | 68,058  | メルコホールディングス  | 4.2   | 3.3   | 12,160    | 12,160    | キーエンス        | 13.3  | 25.4  | 1,524,000 | 1,524,000 |
| 新晃工業          | 5.3   | 6.2   | 10,967  | 10,967  | 日本電気         | 797   | 762   | 227,838   | 227,838   | 日置電機         | 3.8   | 3.2   | 7,568     | 7,568     |
| 大和冷機工業        | 10.8  | 10.2  | 12,586  | 12,586  | 富士通          | 560   | 541   | 457,740   | 457,740   | シスメックス       | 45.6  | 43.5  | 310,155   | 310,155   |
| セガサールホールディングス | 60.9  | 55.3  | 83,337  | 83,337  | 沖電気          | 260   | 23.9  | 35,945    | 35,945    | 日本マイクロナイクス   | —     | 10.7  | 11,074    | 11,074    |
| 日本ビストンリング     | 7.5   | 4     | 9,464   | 9,464   | 電気興業         | 19    | 17    | 9,860     | 9,860     | メガチップス       | 7.7   | 5.6   | 21,084    | 21,084    |
| リケン           | 31    | 2.8   | 15,652  | 15,652  | サンケン電気       | 36    | 34    | 19,788    | 19,788    | OBARA GROUP  | 3.9   | 3.5   | 21,245    | 21,245    |
| T P R         | 7.5   | 6.4   | 22,976  | 22,976  | アイホン         | 4.1   | 4.2   | 7,614     | 7,614     | コーセル         | 9.4   | 8.6   | 12,736    | 12,736    |
| ツバキ・ナカシマ      | —     | 6.3   | 16,184  | 16,184  | ルネサスエレクトロニクス | 33    | 31    | 39,990    | 39,990    | イリソ電子工業      | —     | 4.8   | 29,088    | 29,088    |
| ホシザキ          | 12.9  | 17.7  | 179,478 | 179,478 | セイコーエプソン     | 86.2  | 83.7  | 236,285   | 236,285   | オプテックスグループ   | 4.7   | 4.8   | 20,568    | 20,568    |
| 大豊工業          | 6     | 5.2   | 8,803   | 8,803   | ワコム          | 48.4  | 44.7  | 23,288    | 23,288    | 千代田インテグレ     | 3.6   | 2.9   | 7,342     | 7,342     |
| 日本精工          | 118.7 | 115.6 | 169,007 | 169,007 | アルバック        | 10.9  | 9.7   | 64,699    | 64,699    | レーザータック      | 7.9   | 13.4  | 30,324    | 30,324    |
| N T N         | 145   | 129   | 60,630  | 60,630  | アクセル         | 4.9   | 4.9   | 3,753     | 3,753     | スタンレー電気      | 41.2  | 39.7  | 153,639   | 153,639   |
| ジェイテクト        | 59.8  | 57.6  | 88,185  | 88,185  | E I Z O      | 6.1   | 5.8   | 26,129    | 26,129    | 岩崎電気         | 64    | 33    | 6,534     | 6,534     |
| 不二越           | 54    | 53    | 33,284  | 33,284  | ジャパンディスプレイ   | 110.1 | 108.2 | 21,423    | 21,423    | ウシオ電機        | 35.2  | 32.7  | 49,213    | 49,213    |
| 日本トムソン        | 22    | 20.1  | 12,743  | 12,743  | 日本信号         | 16.6  | 15.4  | 18,972    | 18,972    | 日本セラミック      | 3.9   | 6.2   | 19,127    | 19,127    |
| T H K         | 37.9  | 39.6  | 153,450 | 153,450 | 京三製作所        | 19    | 20    | 11,200    | 11,200    | 遠藤照明         | —     | 4.2   | 5,812     | 5,812     |
| ユーシン精機        | 3.1   | 3.3   | 10,048  | 10,048  | 能美防災         | 7.1   | 6.5   | 11,030    | 11,030    | 日本デジタル研究所    | 6     | —     | —         | —         |
| イーグル工業        | 7.7   | 6.3   | 12,996  | 12,996  | ホーチキ         | 5.6   | 5.1   | 10,801    | 10,801    | 古河電池         | —     | 8     | 9,016     | 9,016     |
| 日本ビラー工業       | 7.5   | 7     | 11,389  | 11,389  | エレコム         | 5.9   | 5.2   | 11,674    | 11,674    | 山一電機         | 11.6  | 6.3   | 12,461    | 12,461    |
| キッツ           | 29.2  | 28.8  | 25,574  | 25,574  | 日本無線         | 21    | 3.5   | 5,848     | 5,848     | 図研           | 8.9   | 5.6   | 9,329     | 9,329     |
| 日立工機          | 7.2   | —     | —       | —       | パナソニック       | 666.3 | 642.1 | 1,060,428 | 1,060,428 | 日本電子         | 27    | 21    | 11,424    | 11,424    |
| マキタ           | 37.5  | 73.1  | 338,087 | 338,087 | アンリツ         | 34.6  | 42.1  | 37,426    | 37,426    | カシオ          | 59.5  | 44.5  | 70,176    | 70,176    |
| 日立造船          | 46.7  | 42.6  | 24,537  | 24,537  | 富士通ゼネラル      | 18    | 19.5  | 44,362    | 44,362    | ファナック        | 59    | 56.7  | 1,290,208 | 1,290,208 |

| 銘柄              | 期首    |       | 当期末   |           | 銘柄            | 期首    |       | 当期末       |           | 銘柄            | 期首    |       | 当期末       |           |
|-----------------|-------|-------|-------|-----------|---------------|-------|-------|-----------|-----------|---------------|-------|-------|-----------|-----------|
|                 | 株数    | 千株    | 株数    | 千株        |               | 株数    | 千株    | 株数        | 千株        |               | 株数    | 千株    | 株数        | 千株        |
| 日本シイエムケイ        | —     | 13.5  | 13.5  | 14,418    | ケーヒン          | 13.2  | 11.6  | 21,274    | 21,274    | タカラトミー        | 20.1  | 22.5  | 32,557    | 32,557    |
| エンプラス           | 3.2   | 2.6   | 2.6   | 12,272    | 河西工業          | 8.3   | 8.5   | 14,382    | 14,382    | 大建工業          | 28    | 4.6   | 12,622    | 12,622    |
| ローム             | 28.2  | 27.2  | 27.2  | 255,680   | アイシン精機        | 59    | 51.4  | 288,354   | 288,354   | 凸版印刷          | 160   | 153   | 170,442   | 170,442   |
| 浜松ホトニクス         | 44.8  | 39.8  | 39.8  | 142,882   | 富士機工          | 10.3  | —     | —         | —         | 大日本印刷         | 168   | 154   | 204,050   | 204,050   |
| 三井ハイテック         | 11.1  | 8.6   | 8.6   | 22,050    | マツダ           | 182.9 | 175.6 | 291,320   | 291,320   | 図書印刷          | 15    | —     | —         | —         |
| 新光電気工業          | 22.8  | 22.4  | 22.4  | 16,979    | 今仙電機製作所       | 7.4   | 8.1   | 10,432    | 10,432    | 共同印刷          | 26    | 19    | 7,068     | 7,068     |
| 京セラ             | 95    | 91.3  | 91.3  | 637,547   | 本田技研          | 523.6 | 502   | 1,653,588 | 1,653,588 | 日本写真印刷        | 10.3  | 10.1  | 29,421    | 29,421    |
| 太陽誘電            | 29.2  | 27    | 27    | 47,034    | スズキ           | 107.9 | 111.3 | 682,046   | 682,046   | 光村印刷          | —     | 29    | 7,134     | 7,134     |
| 村田製作所           | 61.8  | 58.7  | 58.7  | 1,009,933 | SUBARU        | 184.8 | 173.8 | 691,724   | 691,724   | 宝印刷           | 7.8   | 5.7   | 9,399     | 9,399     |
| ユーシン            | 15.2  | 13.5  | 13.5  | 10,854    | ヤマハ発動機        | 81.2  | 79.2  | 259,380   | 259,380   | アシックス         | 54.2  | 55.1  | 92,512    | 92,512    |
| 双葉電子工業          | 10.3  | 8.4   | 8.4   | 17,833    | ショーワ          | 15.9  | 15.9  | 20,367    | 20,367    | ツツミ           | 3.5   | 2     | 3,792     | 3,792     |
| 北陸電気工業          | 86    | 45    | 45    | 7,110     | T B K         | 25.4  | 20    | 9,980     | 9,980     | 小松ウオール工業      | 2.6   | —     | —         | —         |
| ニチコン            | 19.3  | 18.6  | 18.6  | 24,700    | エクセディ         | 7.2   | 7.6   | 25,384    | 25,384    | ヤマハ           | 42.8  | 37.8  | 147,798   | 147,798   |
| 日本ケミコン          | 55    | 51    | 51    | 20,094    | 豊田合成          | 19    | 17.1  | 46,135    | 46,135    | 河合楽器          | 3     | 3.4   | 7,599     | 7,599     |
| K O A           | 9.1   | 8.9   | 8.9   | 18,574    | 愛三工業          | 11.2  | 10    | 10,160    | 10,160    | クリナップ         | 9.1   | 7.1   | 6,404     | 6,404     |
| 市光工業            | —     | 15    | 15    | 10,830    | ヨロズ           | 5.8   | 5.2   | 11,897    | 11,897    | ピジヨン          | 33.2  | 34    | 137,190   | 137,190   |
| 小糸製作所           | 34.7  | 33.6  | 33.6  | 244,608   | エフ・シー・シー      | 9.8   | 9.2   | 23,036    | 23,036    | キングジム         | 8.5   | 8.2   | 8,306     | 8,306     |
| ミツバ             | 10.3  | 10.6  | 10.6  | 17,808    | シマノ           | 23.6  | 22.6  | 336,062   | 336,062   | リントック         | 12.5  | 11.9  | 36,652    | 36,652    |
| スター精密           | 11.9  | —     | —     | —         | テイ・エス テック     | 13.4  | 12.5  | 45,187    | 45,187    | イトーキ          | 13.8  | 13.5  | 11,515    | 11,515    |
| SCREEN ホールディングス | 60    | 11.5  | 11.5  | 87,400    | ジャムコ          | 4.2   | 3.5   | 8,823     | 8,823     | 任天堂           | 36.1  | 34.5  | 1,412,775 | 1,412,775 |
| キャノン電子          | 6     | 6.1   | 6.1   | 13,914    | 精密機器 (1.6%)   | —     | —     | —         | —         | 三菱鉛筆          | 4.6   | 9.6   | 27,254    | 27,254    |
| キャノン            | 311   | 299.5 | 299.5 | 1,149,181 | テルモ           | 89.9  | 85.3  | 385,982   | 385,982   | タカラスタンダード     | 23    | 10.6  | 20,892    | 20,892    |
| リコー             | 187.3 | 166.8 | 166.8 | 183,480   | 日機装           | 22.4  | 20    | 20,560    | 20,560    | コクヨ           | 30.2  | 26.5  | 48,813    | 48,813    |
| 東京エレクトロン        | 47.9  | 37.5  | 37.5  | 646,125   | 島津製作所         | 74    | 71.9  | 162,134   | 162,134   | ナカバヤシ         | 18    | 21    | 7,035     | 7,035     |
| 輸送用機器 (8.9%)    | —     | —     | —     | —         | J M S         | 20    | 22    | 7,436     | 7,436     | グローブライド       | 3.7   | 3.6   | 6,994     | 6,994     |
| トヨタ紡織           | 20.5  | 19.2  | 19.2  | 44,217    | プイ・テクノロジー     | 1.7   | 1.2   | 23,568    | 23,568    | 岡村製作所         | 20.7  | 19.2  | 23,654    | 23,654    |
| ユニプレス           | 12.4  | 10.5  | 10.5  | 30,492    | 東京計器          | 42    | 29    | 8,787     | 8,787     | 美津濃           | 32    | 30    | 19,530    | 19,530    |
| 豊田自動織機          | 51.9  | 51    | 51    | 320,280   | 東京精密          | 11.5  | 10.7  | 42,586    | 42,586    | アデランス         | 13    | —     | —         | —         |
| モリタホールディングス     | 11    | 10.4  | 10.4  | 18,189    | マニー           | 7.3   | 7     | 18,781    | 18,781    | 電気・ガス業 (1.7%) | —     | —     | —         | —         |
| 三桜工業            | 10.4  | 10.3  | 10.3  | 9,321     | ニコン           | 107.5 | 96.1  | 181,629   | 181,629   | 東京電力HD        | 494.9 | 472.5 | 216,405   | 216,405   |
| デンソー            | 143.1 | 137.6 | 137.6 | 757,075   | トプコン          | 20.2  | 28.4  | 57,396    | 57,396    | 中部電力          | 179.1 | 184.3 | 265,115   | 265,115   |
| 東海理化電機          | 16.7  | 13.7  | 13.7  | 29,496    | オリンパス         | 87.5  | 89    | 343,985   | 343,985   | 関西電力          | 241.3 | 229.4 | 353,390   | 353,390   |
| 三井造船            | 231   | 197   | 197   | 27,974    | 理研計器          | 5.9   | 5.9   | 12,620    | 12,620    | 中国電力          | 78.3  | 74.4  | 92,330    | 92,330    |
| 川崎重工業           | 449   | 429   | 429   | 157,443   | タムロン          | 5.4   | 4.2   | 8,950     | 8,950     | 北陸電力          | 55.4  | 51.8  | 52,732    | 52,732    |
| 名村造船所           | 18.4  | 18.4  | 18.4  | 11,573    | H O Y A       | 132.3 | 115   | 720,015   | 720,015   | 東北電力          | 145.3 | 139.9 | 209,010   | 209,010   |
| 日本車輛            | 30    | 26    | 26    | 7,774     | ノーリツ鋼機        | 10.5  | 6.7   | 9,989     | 9,989     | 四国電力          | 51.6  | 50.5  | 71,508    | 71,508    |
| 近畿車輛            | 13    | —     | —     | —         | エー・アンド・デイ     | —     | 13.1  | 7,047     | 7,047     | 九州電力          | 130.2 | 123.1 | 151,905   | 151,905   |
| 日産自動車           | 793.9 | 658.9 | 658.9 | 759,711   | シチズン時計        | 70.2  | 58    | 45,182    | 45,182    | 北海道電力         | 55.2  | 51.5  | 42,951    | 42,951    |
| いすゞ自動車          | 167.3 | 161.7 | 161.7 | 241,013   | リズム時計         | 37    | 39    | 9,126     | 9,126     | 沖縄電力          | 9.6   | 9.8   | 24,049    | 24,049    |
| トヨタ自動車          | 742.2 | 679.3 | 679.3 | 4,571,009 | 大研医器          | 6.7   | 7.1   | 5,530     | 5,530     | 電源開発          | 48.8  | 44.2  | 129,417   | 129,417   |
| 日野自動車           | 82.1  | 80.6  | 80.6  | 109,616   | メニコン          | 4.1   | 3.9   | 17,160    | 17,160    | イーレックス        | —     | 8.2   | 8,601     | 8,601     |
| 三菱自動車工業         | 233.8 | 206   | 206   | 178,190   | 松風            | 4.4   | 4.4   | 5,759     | 5,759     | 東京瓦斯          | 649   | 602   | 345,849   | 345,849   |
| エフテック           | 4.9   | 5     | 5     | 9,025     | セイコーHD        | 38    | 38    | 18,962    | 18,962    | 大阪瓦斯          | 594   | 544   | 233,104   | 233,104   |
| 武蔵精密工業          | 6.5   | 6.9   | 6.9   | 23,356    | ニプロ           | 43.1  | 38.6  | 56,742    | 56,742    | 東邦瓦斯          | 145   | 137   | 95,352    | 95,352    |
| 日産車体            | 24.9  | 23.9  | 23.9  | 30,137    | その他製品 (2.2%)  | —     | —     | —         | —         | 北海道瓦斯         | 34    | 26    | 7,254     | 7,254     |
| 新明和工業           | 26    | 22.7  | 22.7  | 23,358    | パラマウントベッドHD   | 6.3   | 5.2   | 25,662    | 25,662    | 広島ガス          | 23.3  | 20.6  | 7,292     | 7,292     |
| 極東開発工業          | 12.3  | 11.8  | 11.8  | 21,299    | ニホンフラッシュ      | —     | 4.5   | 7,272     | 7,272     | 西部瓦斯          | 67    | 58    | 15,892    | 15,892    |
| 日信工業            | 13.1  | 12    | 12    | 24,048    | 前田工業          | 8     | 7.7   | 14,067    | 14,067    | 静岡ガス          | 18.7  | 13.9  | 12,468    | 12,468    |
| トピー工業           | 52    | 47    | 47    | 17,578    | 永大産業          | 14    | 15    | 8,160     | 8,160     | メタウォーター       | 3.9   | 3.3   | 10,131    | 10,131    |
| ティラド            | 35    | 25    | 25    | 11,500    | アートネイチャー      | 7.1   | 8     | 5,704     | 5,704     | 陸運業 (4.0%)    | —     | —     | —         | —         |
| 曙ブレーキ           | 43.2  | 29.2  | 29.2  | 10,453    | ダンロップスポーツ     | —     | 4.1   | 6,330     | 6,330     | SBS ホールディングス  | 7.7   | 6.8   | 5,344     | 5,344     |
| タチエス            | 9.9   | 9.8   | 9.8   | 19,903    | バンダイナムコ HLDGS | 59.6  | 61.9  | 225,625   | 225,625   | 東武鉄道          | 309   | 294   | 183,750   | 183,750   |
| N O K           | 27.9  | 26.7  | 26.7  | 69,233    | 共立印刷          | 38.4  | 27.1  | 9,322     | 9,322     | 相鉄ホールディングス    | 98    | 85    | 47,005    | 47,005    |
| フタバ産業           | 21.8  | 18.9  | 18.9  | 24,059    | S H O E I     | —     | 3.2   | 10,656    | 10,656    | 東京急行          | 339   | 149.6 | 240,108   | 240,108   |
| K Y B           | 66    | 64    | 64    | 40,640    | フランスベッド HLDGS | 9.4   | 4.3   | 4,510     | 4,510     | 京浜急行          | 155   | 155   | 179,800   | 179,800   |
| 大同メタル工業         | 9.2   | 7.4   | 7.4   | 7,422     | パイロットコーポレーション | 10.3  | 9.7   | 50,343    | 50,343    | 小田急電鉄         | 186   | 88.6  | 189,692   | 189,692   |
| プレス工業           | 32.9  | 30.1  | 30.1  | 18,902    | 萩原工業          | —     | 2.6   | 9,308     | 9,308     | 京王電鉄          | 162   | 152   | 142,728   | 142,728   |
| カルソニックカンセイ      | 45    | —     | —     | —         | トッパン・フォームズ    | 11    | 8.9   | 10,510    | 10,510    | 京成電鉄          | 87    | 41.5  | 128,857   | 128,857   |
| 太平洋工業           | 14    | 13.4  | 13.4  | 19,322    | フジールインターナショナル | 7.1   | 12.8  | 44,672    | 44,672    | 富士急行          | 17    | 16    | 19,520    | 19,520    |

## トピックス・インデックス・マザーファンド

| 銘柄              | 期首    |       | 当期末       |    | 銘柄              | 期首    |       | 当期末     |    | 銘柄             | 期首    |       | 当期末       |    |
|-----------------|-------|-------|-----------|----|-----------------|-------|-------|---------|----|----------------|-------|-------|-----------|----|
|                 | 株数    | 千株    | 株数        | 千株 |                 | 株数    | 千株    | 株数      | 千株 |                | 株数    | 千株    | 株数        | 千株 |
| 新京成電鉄           | 25    | 14    | 5,852     |    | 新日鉄住金 S O L     | 10.2  | 9.2   | 23,018  |    | 日本テレビ HDLS     | 51.9  | 49.5  | 94,693    |    |
| 東日本旅客鉄道         | 106.6 | 108.3 | 1,104,118 |    | ソフトフリエイト HD     | —     | 5.3   | 7,923   |    | テレビ朝日 HD       | 16    | 14.9  | 31,960    |    |
| 西日本旅客鉄道         | 55.9  | 53.9  | 424,570   |    | T I S           | 19.4  | 18.5  | 58,552  |    | スカパー JSATHD    | 46.7  | 33.2  | 16,799    |    |
| 東海旅客鉄道          | 52.1  | 46.4  | 901,784   |    | 電算システム          | 3.4   | 3.3   | 6,402   |    | テレビ東京 HD       | 6.2   | 5.3   | 12,587    |    |
| 西武ホールディングス      | 61.4  | 77.4  | 142,725   |    | グリー             | 36.3  | 38.1  | 29,222  |    | ワイヤレスゲート       | —     | 4.7   | 6,387     |    |
| 鴻池運輸            | 9.1   | 8.7   | 14,207    |    | コーエーテックモ HD     | 14    | 13.1  | 29,697  |    | コネクシオ          | 6.7   | 5.5   | 10,813    |    |
| 西日本鉄道           | 76    | 61    | 33,184    |    | 三菱総合研究所         | 2.9   | 2.6   | 8,450   |    | 日本通信           | 46    | 56.9  | 7,852     |    |
| ハマキョウレックス       | 5.5   | 4.1   | 12,246    |    | ファインデックス        | —     | 5.6   | 4,692   |    | 日本電信電話         | 444   | 442.9 | 2,274,291 |    |
| サカイ引越センター       | 3     | 2.9   | 16,907    |    | K L a b         | 11    | 11.1  | 19,425  |    | K D D I        | 569.3 | 537.9 | 1,603,479 |    |
| 近鉄グループ HDGS     | 577   | 547   | 233,022   |    | ポルトゥウィン・ピットクル   | 9.1   | 5.8   | 8,943   |    | 光通信            | 6.8   | 6.7   | 91,790    |    |
| 阪急阪神 HDGS       | 77.4  | 70    | 297,150   |    | ネクソン            | 56.1  | 61.3  | 180,405 |    | N T T ドコモ      | 429.5 | 405.7 | 1,048,125 |    |
| 南海電鉄            | 130   | 116   | 65,192    |    | アイスタイル          | 11    | 14.5  | 9,497   |    | エムティーアイ        | 10.6  | 10.3  | 7,343     |    |
| 京阪ホールディングス      | 128   | 123   | 82,902    |    | エイチーム           | 4.4   | 5     | 15,325  |    | GMO インターネット    | 22.2  | 21.9  | 32,850    |    |
| 神戸電鉄            | 27    | 22    | 9,086     |    | テクノスジャパン        | —     | 6.1   | 6,453   |    | カドカワ           | 18.3  | 16.3  | 21,907    |    |
| 名古屋鉄道           | 209   | 199   | 98,903    |    | コロプラ            | 16.4  | 17.9  | 22,786  |    | 学研ホールディングス     | 28    | 3.2   | 10,416    |    |
| 山陽電鉄            | 27    | 22    | 12,848    |    | ブロードリーフ         | 7.8   | 15.3  | 13,372  |    | ゼンリン           | 8.4   | 8     | 27,200    |    |
| 日本通運            | 221   | 205   | 151,905   |    | ハーツユナイテッドグループ   | —     | 4.2   | 6,195   |    | 松竹             | 38    | 3.6   | 58,140    |    |
| ヤマトホールディングス     | 106   | 100.2 | 232,063   |    | ティールガイア         | 6.2   | 5.7   | 11,998  |    | 東宝             | 40.9  | 36.1  | 141,873   |    |
| 山九              | 76    | 74    | 66,970    |    | 豆蔵ホールディングス      | —     | 7.2   | 8,085   |    | 東映             | 22    | 20    | 25,440    |    |
| 全昭和運輸           | 24    | 21    | 10,815    |    | テックマトリックス       | —     | 4.6   | 7,134   |    | N T T データ      | 36.4  | 170.3 | 204,360   |    |
| センコーグループ HDGS   | 27    | 26.5  | 21,306    |    | ガンホー・オンライン・エンター | 133.3 | 150.5 | 45,451  |    | D T S          | 7.2   | 6.3   | 19,561    |    |
| トナミホールディングス     | 16    | 15    | 8,025     |    | GMO ベイメントゲートウェイ | 5.2   | 4.2   | 30,114  |    | スクウェア・エニックス・HD | 24.4  | 21.4  | 83,995    |    |
| ニッコンホールディングス    | 17.6  | 17.8  | 47,526    |    | インターネットイニシアティブ  | 9.9   | 9.1   | 19,383  |    | シーイーシー         | 5.9   | 4.4   | 11,215    |    |
| 福山通運            | 34    | 30    | 20,460    |    | さくらインターネット      | —     | 6     | 5,214   |    | カプコン           | 14.9  | 12.9  | 35,126    |    |
| セイノールディングス      | 40    | 38.8  | 58,432    |    | SRA ホールディングス    | 4.3   | 3.5   | 10,251  |    | ジャストテック        | 10.7  | 5.8   | 7,731     |    |
| 神奈川中央交通         | 13    | 8     | 5,864     |    | 朝日ネット           | 15    | 17.6  | 9,363   |    | S C S K        | 14.2  | 15.5  | 71,920    |    |
| 日立物流            | 12.6  | 11.3  | 28,272    |    | コムチュア           | —     | 1.7   | 9,860   |    | アイネス           | 10.1  | 8.8   | 9,002     |    |
| 丸和運輸機関          | —     | 1.7   | 7,837     |    | g u m i         | 8.1   | 7     | 7,637   |    | T K C          | 5.8   | 5.2   | 17,160    |    |
| 九州旅客鉄道          | —     | 56.1  | 183,727   |    | LINE            | 9.5   | 15.8  | 62,410  |    | 富士ソフト          | 9     | 7.5   | 24,525    |    |
| 海運業 (0.2%)      |       |       |           |    | 野村総合研究所         | 40.5  | 41.5  | 174,922 |    | N S D          | 13.1  | 11.7  | 23,844    |    |
| 日本郵船            | 507   | 469   | 108,808   |    | インテージホールディングス   | 4.3   | 3.9   | 11,122  |    | コナミホールディングス    | 26.1  | 25.3  | 142,439   |    |
| 商船三井            | 283   | 292   | 102,492   |    | フジ・メディア・HD      | 58.7  | 56.4  | 88,604  |    | 福井コンピュータ HDLS  | —     | 2.1   | 6,075     |    |
| 川崎汽船            | 257   | 208   | 60,944    |    | オービック           | 19.9  | 19.2  | 133,248 |    | JBCC ホールディングス  | 10    | 11.5  | 12,305    |    |
| NS ユナイテッド海運     | 34    | 29    | 7,105     |    | ジャストシステム        | 12.9  | 10.1  | 24,038  |    | ミロク情報サービス      | 6.6   | 6.4   | 17,043    |    |
| 飯野海運            | 34.9  | 29    | 14,703    |    | TDC ソフトウェアエンジニア | —     | 5.4   | 6,199   |    | ソフトバンクグループ     | 327   | 248.8 | 2,215,315 |    |
| 空運業 (0.6%)      |       |       |           |    | ヤフー             | 424.3 | 405.4 | 205,132 |    | 卸売業 (4.5%)     |       |       |           |    |
| 日本航空            | 110.4 | 97.9  | 370,747   |    | トレンドマイクロ        | 28.1  | 27    | 151,470 |    | エレマテック         | —     | 2.3   | 4,793     |    |
| ANA ホールディングス    | 1,072 | 1,039 | 436,068   |    | 日本オラクル          | 9.6   | 8.9   | 72,980  |    | J A L U X      | 3     | —     | —         |    |
| 倉庫・運輸関連業 (0.2%) |       |       |           |    | フューチャー          | 10.2  | 10.3  | 9,723   |    | あらた            | 3     | 3     | 14,325    |    |
| トランコム           | 2     | 1.8   | 10,926    |    | CAC HOLDINGS    | 9.7   | 6     | 6,288   |    | フィールズ          | 4.7   | 4.4   | 4,972     |    |
| 日新              | 29    | 28    | 16,716    |    | ソフトバンク・テクノ      | —     | 4     | 7,204   |    | 双日             | 366.7 | 309.3 | 94,955    |    |
| 三菱倉庫            | 39    | 34    | 47,464    |    | オービックビジネス C     | 3.2   | 2.9   | 16,327  |    | アルフレッサホールディングス | 71.4  | 64.3  | 131,815   |    |
| 三井倉庫 HOLD       | 39    | 38    | 12,920    |    | 伊藤忠テクノソリューションズ  | 13.3  | 12.9  | 52,374  |    | 横浜冷凍           | 15.7  | 12.8  | 13,964    |    |
| 住友倉庫            | 35    | 35    | 26,040    |    | アイティフォー         | 24    | 14.2  | 8,789   |    | 山下医科器械         | —     | 4     | 6,828     |    |
| 渋沢倉庫            | 22    | 30    | 11,910    |    | 大塚商会            | 15.8  | 16.8  | 118,944 |    | アルコニック         | 5.3   | 8.6   | 15,729    |    |
| 東陽倉庫            | 25    | 26.2  | 8,069     |    | サイボウズ           | 27.5  | 14.2  | 7,284   |    | 神戸物産           | 4.3   | 3.9   | 20,007    |    |
| 日本トランスシティ       | 18    | 20    | 9,360     |    | ソフトラブレン         | —     | 8     | 3,304   |    | あいホールディングス     | 10.8  | 8.2   | 23,042    |    |
| 安田倉庫            | 7.1   | —     | —         |    | 電通国際情報 S        | 4.5   | 4.2   | 10,571  |    | ディー・ビーエックス     | —     | 5.4   | 7,819     |    |
| 東洋埠頭            | 79    | 50    | 9,700     |    | デジタルガレージ        | —     | 11.3  | 25,029  |    | ダイワボウ HD       | 58    | 52    | 23,140    |    |
| 上組              | 64    | 66    | 84,216    |    | ウェザーニューズ        | 2.5   | 2.6   | 9,178   |    | マクニカ・富士エレ HDGS | 10.9  | 10.3  | 20,898    |    |
| キユーソー流通システム     | 2.9   | 2.1   | 6,373     |    | C I J           | 14.1  | 16.4  | 10,381  |    | パイタル K S K HD  | 11.1  | 9.5   | 8,939     |    |
| 郵船ロジスティクス       | 6.7   | 4.7   | 4,728     |    | WOWOW           | 3.5   | 3.4   | 12,648  |    | UKC ホールディングス   | 4.3   | 4.6   | 8,891     |    |
| 近鉄エクスプレス        | 11.1  | 10.2  | 18,023    |    | ネットワンシステムズ      | 26.6  | 25.8  | 29,953  |    | TOKAI ホールディングス | 29.3  | 25.1  | 21,259    |    |
| 東海運             | —     | 11.5  | 4,726     |    | アルゴグラフィックス      | —     | 3.8   | 12,939  |    | 三洋貿易           | 5.3   | 4.7   | 12,328    |    |
| 内外トランスライン       | —     | 6.2   | 9,591     |    | マーベラス           | 11.6  | 10.8  | 10,465  |    | ウイン・パートナーズ     | —     | 6.3   | 9,317     |    |
| 情報・通信業 (7.7%)   |       |       |           |    | エイベックス・グループ HD  | 11.2  | 10.5  | 15,246  |    | シップヘルスケア HD    | 11.8  | 10.2  | 36,567    |    |
| NEC ネットエスアイ     | 7     | 5.8   | 15,602    |    | 日本ユニシス          | 16.8  | 15.7  | 26,909  |    | コメダホールディングス    | —     | 10.4  | 19,541    |    |
| システナ            | 7.4   | 5.3   | 15,004    |    | 兼松エレクトロニクス      | 5.2   | 3.9   | 12,811  |    | 小野建            | 6.5   | 5.5   | 10,466    |    |
| デジタルアーツ         | 4.2   | 2.9   | 13,441    |    | 東京放送 HD         | 33.7  | 36.6  | 76,567  |    | 佐鳥電機           | 14.2  | 8.5   | 8,279     |    |

| 銘柄             | 期首    |       | 当期末       |           | 銘柄                | 期首    |       | 当期末     |         | 銘柄               | 期首      |      | 当期末       |           |
|----------------|-------|-------|-----------|-----------|-------------------|-------|-------|---------|---------|------------------|---------|------|-----------|-----------|
|                | 株数    | 千株    | 株数        | 千株        |                   | 株数    | 千株    | 株数      | 千株      |                  | 株数      | 千株   | 株数        | 千株        |
| 伯東             | —     | 5.3   | 8,851     | 8,851     | サンリオ              | 17.5  | 16.4  | 35,506  | 35,506  | ウエルシアHD          | 5.1     | 15.3 | 69,079    | 69,079    |
| コンドールテック       | —     | 7.7   | 8,631     | 8,631     | サンワテクノス           | 5.9   | —     | —       | —       | クリエイトSDH         | 8.9     | 8.1  | 24,340    | 24,340    |
| ナガイレーベン        | 9.3   | 7.4   | 22,126    | 22,126    | リョーサン             | 9.1   | 7.3   | 34,419  | 34,419  | 丸善CHIHD          | —       | 16.7 | 5,878     | 5,878     |
| 三菱食品           | 6.4   | 5.5   | 17,737    | 17,737    | 新光商事              | 7.7   | 6.9   | 13,061  | 13,061  | チムニー             | 2       | 1.3  | 3,786     | 3,786     |
| 松田産業           | 5.9   | 4.6   | 7,507     | 7,507     | トーホー              | 3.6   | 3.2   | 8,544   | 8,544   | ジョイフル本田          | 9.3     | 9.2  | 26,946    | 26,946    |
| 第一興商           | 10.2  | 8.9   | 47,793    | 47,793    | 三信電気              | 9.6   | 6.9   | 11,447  | 11,447  | 鳥貴族              | —       | 3    | 9,810     | 9,810     |
| メディアバルHD       | 56.5  | 55.1  | 107,059   | 107,059   | 東陽テクニカ            | 10.4  | 7.4   | 7,696   | 7,696   | すかいらーく           | 17.7    | 34   | 55,352    | 55,352    |
| 萩原電気           | —     | 3.5   | 9,747     | 9,747     | モスフードサービス         | 7.7   | 7.2   | 25,668  | 25,668  | 綿半ホールディングス       | —       | 3.6  | 8,870     | 8,870     |
| アズワン           | 4.8   | 4.2   | 26,838    | 26,838    | 加賀電子              | 6     | 5.4   | 17,226  | 17,226  | ユニテッド・スーパーマケ     | 19.4    | 18.9 | 20,393    | 20,393    |
| シモジマ           | 6.3   | 4.9   | 5,507     | 5,507     | PALTA C           | 9.4   | 9.3   | 40,176  | 40,176  | ブックオフコーポレーション    | —       | 11.7 | 9,418     | 9,418     |
| ドウシシャ          | 7.4   | 6.8   | 16,388    | 16,388    | ヤマタネ              | 77    | 5.8   | 10,788  | 10,788  | あさひ              | 5.3     | 4.9  | 6,252     | 6,252     |
| 小津産業           | —     | 4     | 8,480     | 8,480     | 丸紅建材リース           | —     | 34    | 7,582   | 7,582   | 日本調剤             | 1.9     | 2.1  | 7,612     | 7,612     |
| 黒田電気           | 11.2  | 7.3   | 14,519    | 14,519    | 日鉄住金物産            | 47    | 4.7   | 29,140  | 29,140  | コスモス薬品           | 2.9     | 2.8  | 73,332    | 73,332    |
| 丸文             | 11.8  | 5.8   | 4,959     | 4,959     | トラスコ中山            | 6.9   | 11.7  | 31,812  | 31,812  | 一六堂              | —       | 17.1 | 7,079     | 7,079     |
| ハビネット          | 6.5   | 5.8   | 9,854     | 9,854     | オートバックスセブン        | 21.5  | 18.9  | 35,664  | 35,664  | セブン&アイ・HLDGS     | 241.4   | 231  | 1,018,017 | 1,018,017 |
| 日本ライフライン       | —     | 6.7   | 38,056    | 38,056    | 加藤産業              | 8.2   | 8     | 26,480  | 26,480  | 薬王堂              | —       | 3.6  | 10,699    | 10,699    |
| エクセル           | 4.2   | 4.2   | 8,001     | 8,001     | イノテック             | 19.1  | 9.9   | 9,355   | 9,355   | クリエイト・レストランツ・ホール | 16.8    | 17   | 20,281    | 20,281    |
| マルカキカイ         | —     | 4     | 7,308     | 7,308     | イエローハット           | 5.8   | 5.2   | 16,224  | 16,224  | ツルハホールディングス      | 13.5    | 11.2 | 151,872   | 151,872   |
| IDOM           | 16.6  | 17    | 11,390    | 11,390    | 日伝                | 2.9   | 2.7   | 12,312  | 12,312  | サンマルクホールディングス    | 4.8     | 3.6  | 11,916    | 11,916    |
| 進和             | 4.9   | 5.4   | 12,047    | 12,047    | 因幡電機産業            | 6.8   | 6.5   | 28,795  | 28,795  | トリドールホールディングス    | 7.3     | 7.2  | 25,452    | 25,452    |
| シークス           | 4     | 3.6   | 17,010    | 17,010    | ミスミグループ本社         | 64    | 64.2  | 194,526 | 194,526 | クスリのアオキ          | 5.5     | —    | —         | —         |
| 伊藤忠            | 452.9 | 405   | 742,365   | 742,365   | スズケン              | 25.8  | 25    | 98,875  | 98,875  | ダイユー・リックHLDGS    | —       | 9.4  | 8,074     | 8,074     |
| 丸紅             | 559.5 | 546.1 | 405,697   | 405,697   | ジェコス              | 4.9   | 5.5   | 6,726   | 6,726   | クスリのアオキHLDGS     | —       | 4.6  | 31,326    | 31,326    |
| 高島             | 66    | 32    | 7,520     | 7,520     | <b>小売業 (4.6%)</b> |       |       |         |         | メディカルシステムネットワーク  | 14.9    | —    | —         | —         |
| 長瀬産業           | 26    | 30    | 54,690    | 54,690    | ローソン              | 22    | 17.2  | 125,044 | 125,044 | 総合メディカル          | 3.1     | 3    | 15,960    | 15,960    |
| 蝶理             | 4.7   | 4.8   | 10,075    | 10,075    | サンエー              | 4     | 4.2   | 21,000  | 21,000  | ノジマ              | —       | 9.2  | 18,924    | 18,924    |
| 豊田通商           | 62.1  | 61.9  | 226,554   | 226,554   | カワチ薬品             | 4.9   | 4.6   | 12,420  | 12,420  | カッパ・クリエイト        | 9.4     | 7.5  | 9,802     | 9,802     |
| 三共生興           | 13.2  | —     | —         | —         | エービーシー・マート        | 7.6   | 9.9   | 57,717  | 57,717  | ライトオン            | 5.7     | 5.7  | 5,329     | 5,329     |
| 兼松             | 129   | 121   | 33,275    | 33,275    | ハードオフコーポレーション     | 6.9   | 5.3   | 6,031   | 6,031   | 良品計画             | 6.7     | 7.4  | 250,860   | 250,860   |
| 三井物産           | 520.7 | 499   | 841,563   | 841,563   | アスクル              | 7.2   | 6.1   | 20,740  | 20,740  | アドヴァン            | —       | 6.9  | 6,589     | 6,589     |
| 日本紙パルプ         | 28    | 27    | 12,933    | 12,933    | ゲオホールディングス        | 11.2  | 8.8   | 13,569  | 13,569  | アルビス             | 2.3     | 2.2  | 9,339     | 9,339     |
| 日立バイテックロジーズ    | 19.5  | 19.3  | 78,358    | 78,358    | アダストリア            | 10.9  | 8.8   | 21,260  | 21,260  | コナカ              | 11      | 12   | 6,708     | 6,708     |
| カメイ            | 8.5   | 7.6   | 13,087    | 13,087    | くらコーポレーション        | 3.6   | 3.3   | 16,566  | 16,566  | コーナン商事           | 8.9     | 7.6  | 15,716    | 15,716    |
| 東都水産           | 28    | —     | —         | —         | キャンドウ             | 5.6   | 4.5   | 7,875   | 7,875   | ワタミ              | 9       | 7.2  | 11,217    | 11,217    |
| OUGホールディングス    | —     | 27    | 7,803     | 7,803     | バルグループHLDGS       | 3.7   | 3.1   | 11,036  | 11,036  | ドンキホーテホールディング    | 37.2    | 36   | 154,440   | 154,440   |
| スターゼン          | 2.5   | 2.5   | 13,275    | 13,275    | エディオン             | 24.8  | 21    | 22,218  | 22,218  | 西松屋チェーン          | 12      | 9.7  | 12,095    | 12,095    |
| 山善             | 23.4  | 20.6  | 24,369    | 24,369    | サラーコーポレーション       | —     | 11.3  | 10,045  | 10,045  | ゼンショーホールディングス    | 29.4    | 29.2 | 60,414    | 60,414    |
| 住友商事           | 355.2 | 344.9 | 554,771   | 554,771   | ワッツ               | —     | 5.2   | 6,536   | 6,536   | 幸楽苑ホールディングス      | 5.6     | 6.9  | 12,075    | 12,075    |
| 内田洋行           | 19    | 3.2   | 11,056    | 11,056    | ハローズ              | —     | 2.1   | 5,063   | 5,063   | サイゼリヤ            | 9.8     | 8.6  | 26,746    | 26,746    |
| 三菱商事           | 431.9 | 414.6 | 1,086,459 | 1,086,459 | あみやき亭             | 1.5   | 1.8   | 8,559   | 8,559   | V Tホールディングス      | 21.7    | 19.5 | 12,460    | 12,460    |
| 第一実業           | 18    | 17    | 10,455    | 10,455    | ひらまつ              | 12.6  | 14.7  | 9,025   | 9,025   | ポプラ              | —       | 10.5 | 6,174     | 6,174     |
| キャノンマーケティングJPN | 16.3  | 16    | 41,600    | 41,600    | ゲンキー              | 1.7   | 2.5   | 11,462  | 11,462  | ユニテッドアローズ        | 8.3     | 7.6  | 31,160    | 31,160    |
| 西華産業           | 29    | 22    | 13,046    | 13,046    | 大黒天物産             | —     | 1.6   | 8,416   | 8,416   | ハイディ日高           | 5.6     | 6.5  | 22,457    | 22,457    |
| 菱洋エレクトロ        | 7.7   | 5.2   | 10,259    | 10,259    | ハニースホールディングス      | 6.7   | 6.9   | 8,673   | 8,673   | 京都きもの友禅          | 8.5     | 11.3 | 10,576    | 10,576    |
| ユアサ商事          | 6.1   | 5.6   | 21,476    | 21,476    | アルペン              | 5.5   | 3.8   | 8,367   | 8,367   | コロワイド            | 19.3    | 17.6 | 37,065    | 37,065    |
| 神鋼商事           | 54    | 2.6   | 10,153    | 10,153    | クオール              | 6.8   | 6.9   | 13,268  | 13,268  | 壱番屋              | 5.4     | 3.9  | 18,778    | 18,778    |
| 阪和興業           | 59    | 56    | 42,952    | 42,952    | ジーンズ              | 4.1   | 4     | 26,680  | 26,680  | スギホールディングス       | 10.2    | 12.1 | 71,753    | 71,753    |
| カナデン           | 10.1  | 8.9   | 10,475    | 10,475    | ビックカメラ            | 32.6  | 31.7  | 41,241  | 41,241  | スクロール            | 19.8    | 12.7 | 4,965     | 4,965     |
| 菱電商事           | 13    | 10    | 8,050     | 8,050     | DCMホールディングス       | 28    | 32.8  | 33,587  | 33,587  | ヨンドシーホールディングス    | 4.8     | 5.7  | 18,468    | 18,468    |
| 岩谷産業           | 67    | 59    | 39,353    | 39,353    | Monotaro          | 21    | 20.1  | 70,249  | 70,249  | ユニ・ファミリーマートHD    | 25.6006 | 24.4 | 139,812   | 139,812   |
| すてきなスイーツグループ   | 36    | 45    | 6,930     | 6,930     | アークランドサービスHD      | 2.6   | 5.6   | 12,560  | 12,560  | 木曽路              | 7.9     | 6.7  | 18,773    | 18,773    |
| 三菱石油           | 15    | 15.1  | 18,935    | 18,935    | J. フロントリテイリング     | 72.4  | 69.8  | 104,490 | 104,490 | サトレストランジシステムズ    | 10.4    | 10.1 | 9,554     | 9,554     |
| 稲畑産業           | 15.2  | 12.7  | 18,669    | 18,669    | ドトール・日レスHD        | 10.2  | 9.4   | 22,644  | 22,644  | 千趣会              | 14.2    | 13.6 | 9,180     | 9,180     |
| ワキタ            | 12.8  | 12.8  | 16,960    | 16,960    | マツモトキヨシHLDGS      | 11.9  | 10.5  | 82,530  | 82,530  | ケーヨー             | 13.2    | 14.5 | 11,353    | 11,353    |
| 東邦ホールディングス     | 18.7  | 16.8  | 35,095    | 35,095    | ブロンコビルー           | 3.3   | 3.5   | 9,618   | 9,618   | 上新電機             | 15      | 14   | 25,620    | 25,620    |
| サンゲツ           | 20    | 17.7  | 35,612    | 35,612    | スタートトゥデイ          | 18    | 49.4  | 178,087 | 178,087 | 日本瓦斯             | 9       | 10.5 | 37,800    | 37,800    |
| ミツウロコグループ      | 10.9  | 9.5   | 8,208     | 8,208     | 物語コーポレーション        | 1.9   | 2     | 14,360  | 14,360  | ロイヤルホールディングス     | 10      | 9.6  | 27,014    | 27,014    |
| シナモンホールディングス   | 16    | 2.7   | 6,145     | 6,145     | ココカラファイン          | 6.1   | 5.8   | 36,772  | 36,772  | いなげや             | 7.6     | 6.9  | 13,586    | 13,586    |
| 伊藤忠エネクス        | 15.2  | 10.2  | 11,801    | 11,801    | 三越伊勢丹HD           | 113.5 | 110.4 | 126,960 | 126,960 | 島忠               | 14.6    | 13.5 | 37,543    | 37,543    |



| 銘柄             | 期首株数    | 当期末株数   | 当期末評価額    | 銘柄           | 期首株数    | 当期末株数   | 当期末評価額    | 銘柄                | 期首株数    | 当期末株数   | 当期末評価額    |
|----------------|---------|---------|-----------|--------------|---------|---------|-----------|-------------------|---------|---------|-----------|
| 千株             | 千株      | 千円      | 千株        | 千株           | 千円      | 千株      | 千円        | 千株                | 千株      | 千株      | 千円        |
| チヨダ            | 6.8     | 6.3     | 17,696    | 北越銀行         | 64      | 6.4     | 16,115    | トマト銀行             | 85      | 6.2     | 9,442     |
| ライフコーポレーション    | 4.1     | 4.2     | 11,898    | 西日本シティ銀行     | 178     | —       | —         | みなと銀行             | 57      | 5.4     | 10,006    |
| リンガーハット        | 5.8     | 6.7     | 17,219    | 千葉銀行         | 218     | 213     | 162,093   | 京葉銀行              | 44      | 33      | 16,368    |
| AOKIホールディングス   | 13.4    | 9.4     | 13,460    | 常陽銀行         | 198     | —       | —         | 関西アーバン銀行          | 6.7     | 8.8     | 11,730    |
| オークワ           | 10      | 9       | 10,701    | 群馬銀行         | 122     | 119.2   | 79,625    | 栃木銀行              | 33      | 31.5    | 14,616    |
| コメリ            | 8.7     | 8.1     | 25,960    | 武蔵野銀行        | 8.9     | 8       | 25,760    | 北日本銀行             | 2.8     | 3.1     | 9,362     |
| 青山商事           | 10.9    | 11.2    | 44,520    | 千葉興業銀行       | 19      | 17.6    | 9,979     | 東和銀行              | 91      | 119     | 13,923    |
| しまむら           | 6.7     | 6.4     | 86,720    | 筑波銀行         | 27.4    | 30.7    | 11,174    | 福島銀行              | 102     | 108     | 9,612     |
| 高島屋            | 84      | 91      | 94,913    | 七十七銀行        | 87      | 84      | 44,520    | 大東銀行              | 61      | 45      | 7,650     |
| 松屋             | 12.5    | 13.6    | 14,579    | 青森銀行         | 43      | 40      | 17,480    | トモニホールディングス       | 45.2    | 44      | 21,120    |
| エイチ・ツー・オーティリング | 29.2    | 28.1    | 55,272    | 秋田銀行         | 40      | 32      | 11,136    | フィデアホール           | 55.5    | 68.8    | 13,209    |
| 近鉄百貨店          | 27      | 1.5     | 5,580     | 山形銀行         | 34      | 27      | 14,418    | 池田泉州HD            | 53      | 55.2    | 23,349    |
| パルコ            | 6.6     | —       | —         | 岩手銀行         | 4.1     | 2.8     | 12,250    | 証券・商品先物取引業 (1.0%) |         |         |           |
| 丸井グループ         | 70.6    | 58.8    | 95,667    | 東邦銀行         | 49      | 43      | 17,673    | F P G             | 21.2    | 20.7    | 26,640    |
| アクシアルリテイリング    | 4.8     | 4.4     | 19,888    | 東北銀行         | 89      | 73      | 10,950    | SBIホールディングス       | 68.8    | 62.5    | 100,000   |
| イオン            | 238.5   | 226     | 370,301   | みちのく銀行       | 30      | 41      | 7,790     | ジャフコ              | 10      | 9.5     | 52,155    |
| イズミ            | 11.2    | 10.3    | 61,697    | ふくおかフィナンシャルG | 246     | 220     | 107,360   | 大和証券G本社           | 527     | 497     | 315,147   |
| 東武ストア          | 1.7     | —       | —         | 静岡銀行         | 165     | 143     | 142,428   | 野村ホールディングス        | 1,092.9 | 1,128.3 | 712,747   |
| 平和堂            | 11.7    | 10.6    | 26,765    | 十六銀行         | 69      | 62      | 22,072    | 岡三証券グループ          | 42      | 44      | 27,544    |
| フジ             | 6.8     | 5.9     | 16,927    | スルガ銀行        | 56.6    | 56.4    | 131,637   | 丸三証券              | 19.2    | 17.4    | 16,512    |
| ヤオコー           | 6.6     | 6       | 32,580    | 八十二銀行        | 97      | 103.5   | 69,862    | 東洋証券              | 35      | 32      | 8,384     |
| ゼビオホールディングス    | 8       | 7       | 14,770    | 山梨中央銀行       | 34      | 33      | 15,147    | 東海東京HD            | 64.7    | 57.5    | 36,857    |
| ケーズホールディングス    | 23.8    | 22.8    | 55,084    | 大垣共立銀行       | 75      | 84      | 25,452    | 光世証券              | 68      | 39      | 6,474     |
| アインホールディングス    | 7.1     | 7.4     | 59,718    | 福井銀行         | 51      | 51      | 14,790    | 水戸証券              | 27.5    | 28.5    | 9,490     |
| 元気寿司           | —       | 3.2     | 8,105     | 北國銀行         | 59      | 55      | 25,850    | いちよし証券            | 16.2    | 12.5    | 13,200    |
| ヤマダ電機          | 170.9   | 186.5   | 111,527   | 清水銀行         | 2.7     | 3       | 10,095    | 松井証券              | 23.5    | 27.2    | 23,392    |
| アークランドサカモト     | 10.7    | 9.7     | 15,529    | 滋賀銀行         | 49      | 43      | 25,714    | マックスG             | 74.4    | 56.3    | 16,664    |
| ニトリホールディングス    | 25.3    | 24      | 414,000   | 南都銀行         | 52      | 6.5     | 20,117    | カブドットコム証券         | 55.8    | 37.9    | 12,507    |
| 吉野家ホールディングス    | 21.2    | 20.3    | 38,224    | 百五銀行         | 50      | 44      | 20,900    | 植東証券              | 9.9     | 8       | 12,136    |
| 松屋フーズ          | 3.6     | 3.1     | 13,407    | 京都銀行         | 107     | 99      | 107,613   | 岩井コスモホールディング      | 7.8     | 8       | 10,800    |
| サガミチェーン        | 9.5     | 8.5     | 12,010    | 紀陽銀行         | 21.7    | 19.5    | 34,515    | 藍澤證券              | 14.1    | 14.8    | 11,440    |
| 関西スーパーマーケット    | —       | 6.1     | 8,643     | 三重銀行         | 28      | 3.8     | 9,834     | マネースクウェアHD        | 7.8     | —       | —         |
| 王将フードサービス      | 4.3     | 3.4     | 15,402    | ほくほくフィナンシャルG | 370     | 35.1    | 59,880    | マネーパートナーズGP       | —       | 10      | 4,710     |
| プレナス           | 6.7     | 6.5     | 15,892    | 広島銀行         | 165     | 160     | 70,240    | 保険業 (2.4%)        |         |         |           |
| ミニストップ         | 4.9     | 4.3     | 9,399     | 山陰合同銀行       | 34      | 30.6    | 28,488    | かんぽ生命保険           | 24.4    | 20.1    | 47,978    |
| アークス           | 10.7    | 9.5     | 23,854    | 中国銀行         | 37.8    | 37.5    | 55,650    | SOMPOホールディングス     | 126.9   | 115.2   | 521,740   |
| パローホールディングス    | 12.4    | 11.2    | 26,936    | 鳥取銀行         | 34      | 6       | 10,266    | アニコムホールディングス      | 5.2     | 4.2     | 13,776    |
| ベルク            | 3.1     | 2.8     | 15,960    | 伊予銀行         | 55.8    | 78.1    | 65,135    | MS & AD           | 170.3   | 154.2   | 562,830   |
| 大庄             | —       | 4.3     | 7,297     | 百十四銀行        | 60      | 52      | 19,448    | S O N Y F H       | 56.5    | 53.1    | 94,624    |
| ファーストリテイリング    | 9.7     | 9.3     | 305,040   | 四国銀行         | 46      | 45      | 14,895    | 第一生命HLDGS         | 365.3   | 333.2   | 632,913   |
| サンドラッグ         | 12.4    | 21.1    | 98,431    | 阿波銀行         | 44      | 45      | 31,860    | 東京海上HD            | 231.8   | 221.9   | 1,004,097 |
| サックスパーホールディング  | 7       | 6.9     | 9,163     | 大分銀行         | 33      | 29      | 13,282    | T&Dホールディングス       | 207.8   | 200.8   | 314,754   |
| ペルーナ           | 15.9    | 14.1    | 15,806    | 宮崎銀行         | 39      | 38      | 15,200    | アドバンスクリエイト        | —       | 3.5     | 6,807     |
| 銀行業 (7.5%)     |         |         |           | 佐賀銀行         | 38      | 32      | 8,672     | その他金融業 (1.3%)     |         |         |           |
| じもとホールディングス    | 51.6    | 59.2    | 11,899    | 十八銀行         | 37      | 39      | 10,491    | 全国保証              | 15.2    | 16      | 72,320    |
| 足利ホールディングス     | 42.2    | —       | —         | 沖縄銀行         | 5.5     | 5.2     | 23,738    | クレディセゾン           | 43.5    | 41.2    | 84,666    |
| めぐきフィナンシャルG    | —       | 266.8   | 109,654   | 琉球銀行         | 12.5    | 11.5    | 19,067    | 芙蓉総合リース           | 6.7     | 6.5     | 47,450    |
| 東京TYフィナンシャルG   | 8.3     | 8.1     | 22,169    | セブン銀行        | 208.7   | 208.5   | 86,319    | 興銀リース             | 11.1    | 9.9     | 28,759    |
| 九州フィナンシャルG     | 86      | 88.9    | 59,118    | みずほフィナンシャルG  | 8,180.9 | 7,486.6 | 1,465,876 | 東京センチュリー          | 13.4    | 11      | 53,240    |
| ゆうちょ銀行         | 150.5   | 155.4   | 215,850   | 高知銀行         | 107     | 85      | 10,710    | 日本証券金融            | 24.1    | 23.8    | 14,280    |
| 富山第一銀行         | —       | 14.4    | 7,430     | 山口フィナンシャルG   | 51      | 49      | 62,867    | アイフル              | 98.2    | 99.1    | 38,748    |
| パソナフィナンシャルHD   | 393.2   | 357.4   | 199,464   | 長野銀行         | 33      | 4.6     | 8,891     | ポケっとカード           | 9.4     | —       | —         |
| 新生銀行           | 519     | 523     | 91,525    | 名古屋銀行        | 48      | 4       | 17,260    | リコーリース            | 4.9     | 4.8     | 19,968    |
| あおぞら銀行         | 372     | 346     | 147,742   | 北洋銀行         | 82.5    | 84.8    | 29,086    | イオンフィナンシャルサービス    | 37.4    | 35.5    | 83,744    |
| 三菱UFJフィナンシャルG  | 4,616.9 | 4,183.2 | 2,965,328 | 愛知銀行         | 2.1     | 2       | 13,100    | アコム               | 122.6   | 116.7   | 50,997    |
| りそなホールディングス    | 673.8   | 647.2   | 357,836   | 第二銀行         | 39      | 3.5     | 6,212     | ジャックス             | 33      | 32      | 17,440    |
| 三井住友トラストHD     | 1,195   | 114.9   | 456,727   | 中京銀行         | 27      | 2.2     | 5,192     | オリコ               | 248.4   | 118     | 21,594    |
| 三井住友フィナンシャルG   | 461.2   | 442.4   | 1,897,011 | 大光銀行         | 28      | 30      | 7,200     | 日立キャピタル           | 13.9    | 12.9    | 34,043    |
| 第四銀行           | 66      | 63      | 33,201    | 愛媛銀行         | 31      | 7.1     | 10,195    | オリックス             | 408.8   | 390.2   | 707,042   |

| 銘柄                  | 期首    |       | 当期末     |     |
|---------------------|-------|-------|---------|-----|
|                     | 株数    | 株数    | 株数      | 評価額 |
|                     | 千株    | 千株    | 千株      | 千円  |
| 三菱UFJリソース           | 141.1 | 140   | 80,920  |     |
| 日本取引所グループ           | 166.7 | 173.4 | 334,141 |     |
| イー・キャランティ           | 3.1   | 2.7   | 8,451   |     |
| NECキャピタルソリューション     | 3.4   | 3.5   | 7,336   |     |
| <b>不動産業 (2.3%)</b>  |       |       |         |     |
| いちご                 | 60.9  | 53.6  | 20,153  |     |
| 日本駐車場開発             | 78.1  | 80.7  | 13,315  |     |
| ヒューリック              | 120   | 115.6 | 121,148 |     |
| 野村不動産 HLDGS         | 37    | 39.3  | 87,914  |     |
| 三重交通グループHD          | 14.7  | 9.9   | 4,415   |     |
| サムティ                | —     | 6.2   | 10,434  |     |
| 日本商業開発              | —     | 4.7   | 8,272   |     |
| プリアンコーポレーション        | 2.3   | 9.7   | 14,928  |     |
| ユニゾホールディングス         | 4.1   | 5.5   | 14,294  |     |
| 日本管理センター            | 5.5   | 4.6   | 6,900   |     |
| フージャースHD            | —     | 10.9  | 12,524  |     |
| オープンハウス             | 8.9   | 9.4   | 33,229  |     |
| 三重交通グループHD          | 139.3 | 129.3 | 84,950  |     |
| 飯田GHD               | 52.6  | 45.4  | 88,257  |     |
| パーク24               | 29    | 30.9  | 83,955  |     |
| パラカ                 | —     | 3.5   | 8,659   |     |
| 三井不動産               | 305   | 293.2 | 685,208 |     |
| 三菱地所                | 431   | 411.4 | 781,660 |     |
| 平和不動産               | 12.2  | 11.3  | 22,046  |     |
| 東京建物                | 62.8  | 59    | 81,597  |     |
| ダイビル                | 15.7  | 14.4  | 16,488  |     |
| 京阪神ビルディング           | 11.8  | 12.7  | 9,017   |     |
| 住友不動産               | 138   | 133   | 457,387 |     |
| 大京                  | 107   | 105   | 22,785  |     |
| テオオーシー              | 23    | 19.5  | 19,734  |     |
| 東京楽天地               | 19    | 1.4   | 7,756   |     |
| レオパレス21             | 67.8  | 68.7  | 55,303  |     |
| スターツコーポレーション        | 6.9   | 7.8   | 22,113  |     |
| フジ住宅                | 12.2  | 10.5  | 8,557   |     |
| 空港施設                | 12.1  | 7.6   | 4,484   |     |
| 住友不動産販売             | 4.6   | —     | —       |     |
| ゴールドクレスト            | 4.9   | 5.4   | 13,732  |     |
| 日神不動産               | —     | 11.1  | 8,047   |     |
| タカラレーベン             | 27.1  | 25.2  | 13,255  |     |
| サンヨーハウジング名古屋        | 5.9   | 8.2   | 8,593   |     |
| イオンモール              | 36    | 36    | 72,180  |     |
| ファースト住建             | —     | 4     | 6,784   |     |
| トーセイ                | 11.1  | 10.1  | 9,393   |     |
| エヌ・ティ・ティ都市開発        | 34.4  | 34    | 36,686  |     |
| サンフロンティア不動産         | 8.5   | 7.1   | 8,094   |     |
| エフ・ジェー・ネクスト         | 14.9  | 8.9   | 8,650   |     |
| グランディハウス            | —     | 16    | 6,896   |     |
| 日本空港ビルデング           | 18.2  | 17.7  | 67,083  |     |
| <b>サービス業 (4.0%)</b> |       |       |         |     |
| 日本工営                | 23    | 4.5   | 16,065  |     |
| LIFULL              | 18.6  | 16.4  | 15,563  |     |
| ジェイエイリクルートメント       | —     | 4.9   | 8,187   |     |
| 日本M&Aセンター           | 9.7   | 17.2  | 93,052  |     |
| Aコーディア・ゴルフ          | 16.7  | —     | —       |     |
| タケエイ                | 9.3   | 6.7   | 7,952   |     |
| トラスト・テック            | —     | 3.8   | 11,856  |     |
| パソナグループ             | 7.4   | 5.8   | 6,832   |     |
| CDS                 | —     | 6.3   | 7,919   |     |
| リンクアンドモチベーション       | —     | 13    | 9,035   |     |

| 銘柄             | 期首    |       | 当期末     |     |
|----------------|-------|-------|---------|-----|
|                | 株数    | 株数    | 株数      | 評価額 |
|                | 千株    | 千株    | 千株      | 千円  |
| GCA            | 8.6   | 7.5   | 7,762   |     |
| エス・エム・エス       | 8.6   | 8.8   | 32,252  |     |
| パーソルホールディングス   | 43.6  | 46.1  | 111,008 |     |
| リニカル           | —     | 4.1   | 6,227   |     |
| クックパッド         | 14.5  | 17.9  | 13,872  |     |
| スタジオアリス        | 3.6   | 2.9   | 7,693   |     |
| シミックホールディングス   | 4.2   | 3.4   | 5,225   |     |
| 総合警備保障         | 20.7  | 21.6  | 111,024 |     |
| カカココム          | 44.5  | 42.3  | 57,654  |     |
| ルネサンス          | —     | 5.2   | 9,235   |     |
| ディップ           | 7.6   | 8.4   | 21,420  |     |
| オプトホールディング     | —     | 6.7   | 8,361   |     |
| 新日本科学          | —     | 8.6   | 4,609   |     |
| ツクイ            | 17    | 16.3  | 12,290  |     |
| エムスリー          | 54.1  | 51.6  | 166,410 |     |
| ツカダ・グローバルHOLD  | 6.8   | —     | —       |     |
| アウトソーシング       | 3.3   | 3.4   | 24,446  |     |
| ウェルネット         | 6.3   | 5.7   | 6,555   |     |
| ディー・エヌ・エー      | 28.1  | 27    | 65,799  |     |
| 博報堂DY HLDGS    | 83.4  | 81.5  | 119,316 |     |
| ぐるなび           | 7.5   | 8.7   | 14,276  |     |
| エスアールジータカミヤ    | —     | 10.4  | 6,624   |     |
| ジャパンベストレスクース   | —     | 16.5  | 7,078   |     |
| ファンコミュニケーションズ  | 15.9  | 16.3  | 19,820  |     |
| ティア            | —     | 10.1  | 8,766   |     |
| インフォマート        | 13    | 29.3  | 22,912  |     |
| JPホールディングス     | 22.2  | 23.7  | 9,077   |     |
| EPSホールディングス    | 7.7   | 8.3   | 17,488  |     |
| プレステージ・インター    | 6.7   | 13.2  | 14,995  |     |
| アミューズ          | 4.2   | 3.9   | 10,857  |     |
| ドリームインキュベータ    | 3.6   | 2.7   | 5,861   |     |
| クイック           | —     | 5.1   | 9,373   |     |
| ケネディクス         | 82.3  | 76.4  | 43,548  |     |
| 電通             | 68.1  | 65.1  | 306,946 |     |
| イオンファンタジー      | 3     | 2.1   | 7,948   |     |
| シーティーエス        | —     | 9.8   | 7,379   |     |
| みらかホールディングス    | 15.3  | 14.6  | 74,460  |     |
| アルプス技研         | 3.8   | 3.1   | 11,315  |     |
| オリエンタルランド      | 66.3  | 63.3  | 538,113 |     |
| ダスキン           | 17.3  | 14.4  | 44,460  |     |
| 明光ネットワークジャパン   | 8.9   | 7.9   | 11,826  |     |
| ファルコホールディングス   | 4.1   | 6.6   | 10,824  |     |
| ラウンドワン         | 20.8  | 19.5  | 25,213  |     |
| リゾートトラスト       | 25.2  | 22.7  | 45,695  |     |
| ピー・エム・エル       | 8     | 7.5   | 17,992  |     |
| りらいあコミュニケーション  | 11    | 10.7  | 14,113  |     |
| リソー教育          | —     | 12.9  | 10,797  |     |
| ユー・エス・エス       | 73    | 70.8  | 158,592 |     |
| サイバーエージェント     | 16.2  | 36    | 120,600 |     |
| 楽天             | 310.8 | 276.3 | 345,375 |     |
| デー・オー・ダブリュー    | —     | 8.9   | 7,342   |     |
| セントラルススポーツ     | 3     | 3.2   | 13,072  |     |
| フルキャストホールディングス | 8     | 6     | 11,598  |     |
| テクノプロ・ホールディング  | 10.3  | 10    | 52,800  |     |
| ジャパンマテリアル      | 3.2   | 4.5   | 13,234  |     |
| ベクトル           | 8.4   | 6.2   | 9,486   |     |
| アサンテ           | —     | 4.2   | 7,854   |     |
| N・フィールド        | —     | 4.5   | 7,402   |     |
| リクルートホールディングス  | 124.1 | 385.7 | 948,822 |     |

| 銘柄             | 期首    |            | 当期末      |             |
|----------------|-------|------------|----------|-------------|
|                | 株数    | 株数         | 株数       | 評価額         |
|                | 千株    | 千株         | 千株       | 千円          |
| 日本郵政           | 180.8 | 149.8      | 212,716  |             |
| ベルシステム24HLDGS  | —     | 10.1       | 11,958   |             |
| リログループ         | 2.4   | 30.4       | 78,067   |             |
| 東洋             | 2.2   | 2.1        | 11,550   |             |
| エイチ・アイ・エス      | 10    | 8.7        | 30,711   |             |
| 共立メンテナンス       | 4.7   | 9.5        | 30,732   |             |
| イチネンホールディングス   | 11.7  | 7.1        | 10,607   |             |
| 建設技術研究所        | 5.7   | 7.2        | 7,430    |             |
| 東京テアトル         | 98    | 60         | 9,180    |             |
| タナベ経営          | —     | 4.3        | 6,101    |             |
| ナガワ            | —     | 1.1        | 4,532    |             |
| よみうりランド        | 18    | 15         | 7,230    |             |
| 東京競馬           | 45    | 4.3        | 14,319   |             |
| 常磐興産           | 79    | 5.8        | 10,590   |             |
| カナモト           | 8.6   | 8.4        | 29,106   |             |
| 東京ドーム          | 26    | 22.6       | 22,758   |             |
| 西尾レントオール       | 5.1   | 4.9        | 18,571   |             |
| トランス・コスモス      | 7.6   | 6.8        | 17,081   |             |
| 乃村工務社          | 13.9  | 13.5       | 34,276   |             |
| 藤田観光           | 25    | 2.2        | 7,755    |             |
| KNT-CTホールディングス | 37    | 40         | 8,760    |             |
| 日本管財           | 6.2   | 5.2        | 10,550   |             |
| トコカイ           | 3.1   | 2.7        | 13,230   |             |
| セコム            | 63.4  | 60.3       | 502,057  |             |
| セントラル警備保障      | —     | 3.5        | 7,301    |             |
| 丹青社            | 13.6  | 12.1       | 17,024   |             |
| メイテック          | 7.8   | 6.9        | 37,812   |             |
| アサツー ディ・ケイ     | 10.7  | 10         | 30,750   |             |
| 応用地質           | 7.4   | 7          | 11,396   |             |
| 船井総研ホールディング    | 9.9   | 8.3        | 28,469   |             |
| 学究社            | —     | 5.1        | 7,797    |             |
| ベネッセホールディングス   | 20    | 19.8       | 77,121   |             |
| イオンディライト       | 6.2   | 6.5        | 26,520   |             |
| ニチエ学館          | 12    | 11.6       | 13,873   |             |
| ダイセキ           | 12.1  | 10.2       | 29,121   |             |
|                |       |            |          |             |
| 合計             |       | 千株         | 千株       | 千円          |
| 株数、金額          |       | 13,107,006 | 83,168.1 | 135,585,875 |
| 銘柄数<比率>        |       | 1,397銘柄    | 1,488銘柄  | <99.2%>     |

(注1) 銘柄欄の( )内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

| 銘柄別   | 当期末 |     |
|-------|-----|-----|
|       | 買建額 | 売建額 |
| 国内    | 百万円 | 百万円 |
| TOPIX | 991 | —   |

(注) 単位未満は切捨て。



■有価証券の貸付及び借入の状況

| 項 目 | 当 期 末                           |                |
|-----|---------------------------------|----------------|
|     | 貸 付                             | 借 入            |
| 株式  | 株<br>2, 246, 000<br>( 392, 600) | 株<br>—<br>( —) |

(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、大和証券へ392,600株を貸付  
けています。

■投資信託財産の構成

2017年9月19日現在

| 項 目          | 当 期 末         |        |
|--------------|---------------|--------|
|              | 評 価 額         | 比 率    |
|              | 千円            | %      |
| 株式           | 135, 585, 875 | 96. 2  |
| コール・ローン等、その他 | 5, 343, 291   | 3. 8   |
| 投資信託財産総額     | 140, 929, 166 | 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

2017年9月19日現在

| 項 目             | 当 期 末               |
|-----------------|---------------------|
| (A) 資産          | 141, 500, 706, 473円 |
| コール・ローン等        | 5, 243, 157, 160    |
| 株式 (評価額)        | 135, 585, 875, 410  |
| 未収入金            | 47, 378, 960        |
| 未収配当金           | 47, 733, 767        |
| 未収利息            | 275, 624            |
| その他未収収益         | 4, 745, 552         |
| 差入委託証拠金         | 571, 540, 000       |
| (B) 負債          | 4, 792, 327, 532    |
| 未払解約金           | 188, 293, 300       |
| 差入委託証拠金代用有価証券   | 601, 800, 000       |
| 受入担保金           | 4, 002, 234, 232    |
| (C) 純資産総額 (A－B) | 136, 708, 378, 941  |
| 元本              | 132, 992, 880, 740  |
| 次期繰越損益金         | 3, 715, 498, 201    |
| (D) 受益権総口数      | 132, 992, 880, 740口 |
| 1万口当り基準価額 (C／D) | 10, 279円            |

\* 期首における元本額は143,240,630,767円、当期中における追加設定元本額は15,781,466,537円、同解約元本額は26,029,216,564円です。  
\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、トピ  
ックス・インデックスファンド4,876,025,306円、ダイワ・トピックス・インデッ  
クスファンドV A12,004,610,396円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックス  
インデックスファンドV A2 63,814,361円、ダイワ国内重視バランスファンド30  
V A (一般投資家私募) 98,324,013円、ダイワ国内重視バランスファンド50V A  
(一般投資家私募) 1,596,875,323円、ダイワ国際分散バランスファンド30V A  
(一般投資家私募) 73,496,283円、ダイワ国際分散バランスファンド50V A (一  
般投資家私募) 2,267,542,428円、D－I’s T O P I X インデックス29,570,535  
円、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド27,492,055円、D Cダイワ・  
ターゲットイヤー2050 571,628円、iFree T O P I X インデックス219,320,903

円、iFree 8資産バランス560,747,176円、D Cダイワ日本株式インデックス  
61,209,294,542円、ダイワ・ライフ・バランス30 2,305,738,742円、ダイワ・ライ  
フ・バランス50 2,363,094,190円、ダイワ・ライフ・バランス70 2,234,782,816  
円、年金ダイワ日本株式インデックス3,968,008,120円、D Cダイワ・ターゲッ  
トイヤー2020 20,185,626円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 59,526,245円、  
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 12,595,154円、ダイワ世界分散バランスファ  
ンド15V A404,752円、ダイワ世界分散バランスファンド20V A400,556円、ダイ  
ワ世界分散バランスファンド20V A (国内株式型) 753,865円、ダイワ世界分散バ  
ランスファンド25V A11,529,912円、ダイワ世界分散バランスファンド30V A  
47,889,757円、ダイワ世界分散バランスファンド30V A (国内株式型)  
27,538,772円、ダイワ世界バランスファンド40V A532,798,059円、ダイワ世界バ  
ランスファンド60V A191,358,243円、ダイワ・バランスファンド35V A  
11,883,395,819円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50V A319,015,775円、  
ダイワ・ワールド・バランスファンド75V A481,942,796円、ダイワ・バランス  
ファンド25V A (適格機関投資家専用) 1,022,475,874円、ダイワ国内バランス  
ファンド25V A (適格機関投資家専用) 148,071,718円、ダイワ国内バランスファ  
ンド30V A (適格機関投資家専用) 256,045,701円、ダイワ・ノーロード T O P I X  
ファンド58,249,473円、ダイワファンドラップ T O P I X インデックス  
5,574,613,851円、ダイワT O P I X インデックス (ダイワS M A 専用)  
4,252,692円、ダイワファンドラップオンライン T O P I X インデックス  
963,778,473円、ダイワ・インデックスセレクト T O P I X1,204,591,549円、ダ  
イワライフスタイル25 192,618,067円、ダイワライフスタイル50 643,116,079  
円、ダイワライフスタイル75 521,030,501円、D C・ダイワ・トピックス・イン  
デックス (確定拠出年金専用ファンド) 14,915,392,614円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,279円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月21日 至2017年9月19日

| 項 目                       | 当 期                 |
|---------------------------|---------------------|
| (A) 配当等収益                 | 2, 674, 016, 966円   |
| 受取配当金                     | 2, 576, 538, 540    |
| 受取利息                      | 6, 617, 221         |
| その他収益金                    | 94, 789, 458        |
| 支払利息                      | △ 3, 928, 253       |
| (B) 有価証券売買損益              | 29, 454, 468, 521   |
| 売買益                       | 30, 520, 937, 463   |
| 売買損                       | △ 1, 066, 468, 942  |
| (C) 先物取引等損益               | 286, 442, 800       |
| 取引益                       | 343, 104, 040       |
| 取引損                       | △ 56, 661, 240      |
| (D) その他費用                 | △ 757, 521          |
| (E) 当期損益金 (A + B + C + D) | 32, 414, 170, 766   |
| (F) 前期繰越損益金               | △ 29, 448, 186, 614 |
| (G) 解約差損益金                | 1, 786, 186, 636    |
| (H) 追加信託差損益金              | △ 1, 036, 672, 587  |
| (I) 合計 (E + F + G + H)    | 3, 715, 498, 201    |
| 次期繰越損益金 (I)               | 3, 715, 498, 201    |

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

# ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

★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                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                   |
| 運用方針         | 投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。                                                                                                                                                                                                           |                                                   |
| 主要投資対象       | ベビーファンド                                                                                                                                                                                                                                                      | 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券                      |
|              | 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                      | 海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。） |
| マザーファンドの運用方法 | ①主として海外の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。<br>②保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。<br>③運用の効率化を図るため、株式指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等の組入総額ならびに株式指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 |                                                   |
| 組入制限         | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                        | 無制限                                               |
|              | ベビーファンドの株式実質組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                           |                                                   |
|              | マザーファンドの株式組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                             |                                                   |
| 分配方針         | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。                                                                                                                              |                                                   |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

## 運用報告書（全体版） 第1期 (決算日 2017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。

さて、「ダイワファンドラップオンライン外国株式インデックス（為替ヘッジあり）」は、このたび、第1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

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）

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

設定以来の運用実績

| 決 算 期             | 基 準 価 額     |            |            | MSCIコクサイ指数<br>(円ヘッジ・ベース) |            | 株式組入<br>比 率 | 株式先物<br>比 率 | 投資信託<br>受益証券<br>組入比率 | 投 資 信託証券<br>組入比率 | 純 資 産 額      |
|-------------------|-------------|------------|------------|--------------------------|------------|-------------|-------------|----------------------|------------------|--------------|
|                   |             | 税込み<br>分配金 | 期 中<br>騰落率 | (ベンチマーク)                 | 期 中<br>騰落率 |             |             |                      |                  |              |
| 1 期末(2017年11月30日) | 円<br>11,363 | 円<br>0     | %<br>13.6  | 11,186                   | %<br>11.9  | %<br>92.8   | %<br>3.6    | %<br>0.0             | %<br>2.5         | 百万円<br>1,294 |

(注 1) MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）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として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注 2) 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。

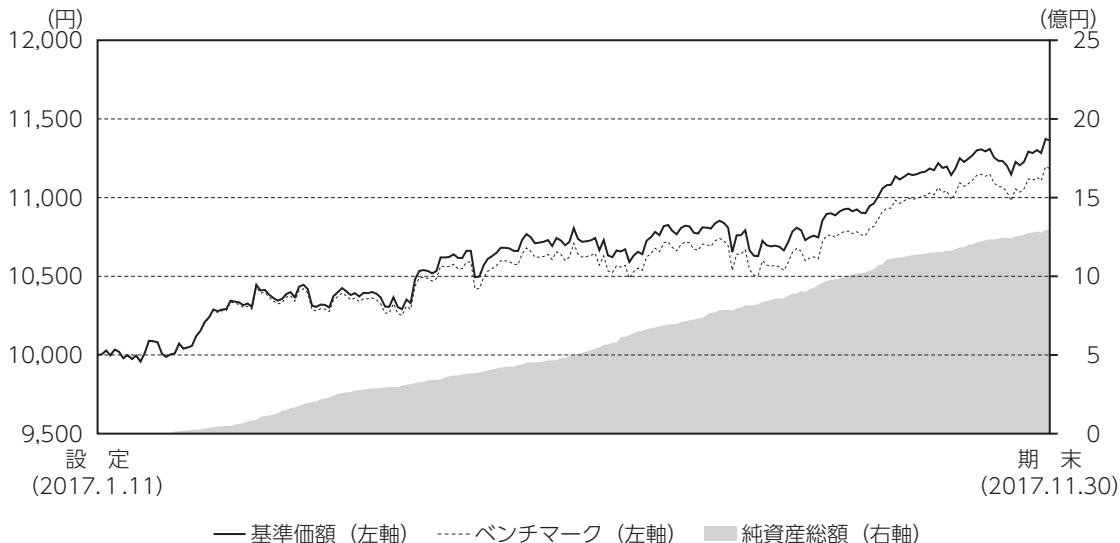
(注 3) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注 4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、設定時を10,000として指数化したものです。

\*ベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）です。

#### ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：11,363円

騰落率：13.6%

#### ■基準価額の主な変動要因

マザーファンドの受益証券を通じてベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース））の動きに連動させることをめざして運用を行なった結果、米国の新大統領による政策への期待や好調な企業決算を好感して海外株式市況が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

| 年 月 日             | 基 準 価 額     |        | MSCIコクサイ指数<br>(円ヘッジ・ベース) |        | 株 式 組 入 率<br>比 | 株 式 先 物 率<br>比 | 投 資 信 託 証 券 率<br>組 入 証 比 | 投 信 託 証 比 | 資 券 率  |
|-------------------|-------------|--------|--------------------------|--------|----------------|----------------|--------------------------|-----------|--------|
|                   |             | 騰 落 率  | (ベンチマーク)                 | 騰 落 率  |                |                |                          |           |        |
| (設定) 2017年 1 月11日 | 円<br>10,000 | %<br>－ | (1/10)<br>10,000         | %<br>－ | %<br>－         | %<br>－         | %<br>－                   | %<br>－    | %<br>－ |
| 1 月末              | 10,008      | 0.1    | 10,007                   | 0.1    | 91.0           | 4.7            | －                        | 2.3       |        |
| 2 月末              | 10,327      | 3.3    | 10,309                   | 3.1    | 91.7           | 5.5            | －                        | 2.4       |        |
| 3 月末              | 10,425      | 4.3    | 10,394                   | 3.9    | 93.2           | 6.1            | －                        | 2.4       |        |
| 4 月末              | 10,534      | 5.3    | 10,486                   | 4.9    | 92.0           | 5.8            | －                        | 2.4       |        |
| 5 月末              | 10,662      | 6.6    | 10,577                   | 5.8    | 93.2           | 4.6            | －                        | 2.4       |        |
| 6 月末              | 10,633      | 6.3    | 10,534                   | 5.3    | 95.9           | 3.5            | 0.0                      | 2.5       |        |
| 7 月末              | 10,777      | 7.8    | 10,673                   | 6.7    | 94.2           | 2.4            | 0.0                      | 2.6       |        |
| 8 月末              | 10,716      | 7.2    | 10,586                   | 5.9    | 95.3           | 2.3            | 0.0                      | 2.7       |        |
| 9 月末              | 10,963      | 9.6    | 10,817                   | 8.2    | 97.3           | 2.7            | 0.0                      | 2.6       |        |
| 10月末              | 11,226      | 12.3   | 11,071                   | 10.7   | 94.9           | 2.7            | 0.0                      | 2.5       |        |
| (期末) 2017年11月30日  | 11,363      | 13.6   | 11,186                   | 11.9   | 92.8           | 3.6            | 0.0                      | 2.5       |        |

(注) 騰落率は設定比。

## 投資環境について

(2017.1.11～2017.11.30)

### ■外国株式市況

米国・欧州を中心とする外国株式市況は上昇しました。

設定時より、米国トランプ大統領が金融規制を抜本的に見直す大統領令に署名したことや、大型減税を示唆したことなどを受けて景気拡大への期待が高まったことなどを好感し、市況は上昇して始まりました。2017年4月以降も、市場予想通りの結果となったフランス大統領選挙や米国企業の好調な4－6月期決算発表が好材料となり、市況は底堅く推移しました。9月以降は、ECB（欧州中央銀行）が2017年のEU（欧州連合）圏の成長率見通しを引き上げたこと、また米国の良好な経済指標や税制改革法案成立への期待感などが好感され、市況は上昇基調を継続して期末を迎えました。

## ポートフォリオについて

(2017.1.11～2017.11.30)

### ■当ファンド

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

### ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

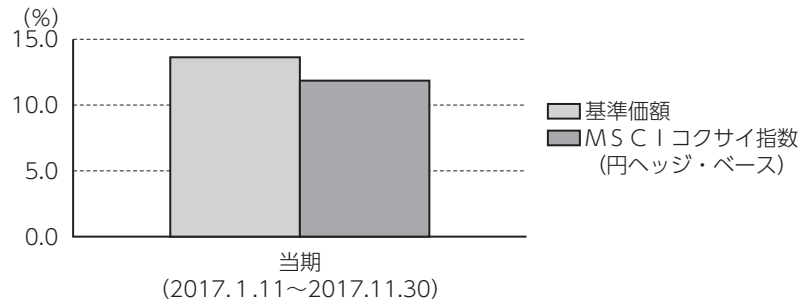
ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式（投資信託証券、株式先物を含む。）等のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで、基準価額とベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース））との連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は11.9%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%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目        | 当 期        |             |
|------------|------------|-------------|
|            | 2017年1月11日 | 2017年11月30日 |
| 当期分配金（税込み） | (円)        | —           |
| 対基準価額比率    | (%)        | —           |
| 当期の収益      | (円)        | —           |
| 当期の収益以外    | (円)        | —           |
| 翌期繰越分配対象額  | (円)        | 1,363       |

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

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

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





## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

1 万口当りの費用の明細

| 項 目        | 当期<br>(2017.1.11～2017.11.30) |         | 項 目 の 概 要                                                          |
|------------|------------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------|
|            | 金 額                          | 比 率     |                                                                    |
| 信 託 報 酬    | 31円                          | 0.292%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は10,657円です。                       |
| (投 信 会 社)  | (24)                         | (0.225) | 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、目<br>論見書・運用報告書の作成等の対価         |
| (販 売 会 社)  | (5)                          | (0.048) | 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<br>の情報提供等の対価                |
| (受 託 銀 行)  | (2)                          | (0.019) | 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    | 2                            | 0.015   | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<br>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)                          | (0.013) |                                                                    |
| (先 物)      | (0)                          | (0.001) |                                                                    |
| (投資信託受益証券) | (0)                          | (0.000) |                                                                    |
| (投資信託証券)   | (0)                          | (0.000) |                                                                    |
| 有価証券取引税    | 2                            | 0.022   | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金   |
| (株 式)      | (2)                          | (0.021) |                                                                    |
| (投資信託受益証券) | (0)                          | (0.000) |                                                                    |
| (投資信託証券)   | (0)                          | (0.000) |                                                                    |
| そ の 他 費 用  | 9                            | 0.086   | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数                                          |
| (保 管 費 用)  | (9)                          | (0.081) | 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・<br>資産の移転等に要する費用             |
| (監 査 費 用)  | (0)                          | (0.005) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                        |
| (そ の 他)    | (0)                          | (0.001) | 信託事務の処理等に関するその他の費用                                                 |
| 合 計        | 44                           | 0.415   |                                                                    |

(注 1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 比率欄は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

|                         | 設 定     |           | 解 約   |       |
|-------------------------|---------|-----------|-------|-------|
|                         | 口 数     | 金 額       | 口 数   | 金 額   |
|                         | 千口      | 千円        | 千口    | 千円    |
| 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド | 720,731 | 1,223,030 | 3,797 | 6,691 |

(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

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

| 項 目               | 当 期                     |
|-------------------|-------------------------|
|                   | 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 13,626,107千円            |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 20,368,634千円            |
| (c) 売買高比率 (a)÷(b) | 0.66                    |

(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

当期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

| 設定時保有額 | 期中設定額 | 期中解約額 | 期末保有額 | 取引の理由            |
|--------|-------|-------|-------|------------------|
| 百万円    | 百万円   | 百万円   | 百万円   |                  |
| 1      | －     | 1     | －     | 当初設定時における取得とその処分 |

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

| 種 類                     | 当 期 末   |           |
|-------------------------|---------|-----------|
|                         | 口 数     | 評 価 額     |
|                         | 千口      | 千円        |
| 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド | 716,933 | 1,294,352 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017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為替ヘッジ型マザーファンド | 1,294,352 | 99.8  |
| コール・ローン等、その他            | 2,124     | 0.2   |
| 投資信託財産総額                | 1,296,477 | 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＝112.05円、1カナダ・ドル＝87.10円、1オーストラリア・ドル＝84.87円、1香港ドル＝14.35円、1シンガポール・ドル＝83.19円、1ニュージーランド・ドル＝76.68円、1イギリス・ポンド＝150.33円、1イスラエル・シェケル＝31.98円、1スイス・フラン＝113.83円、1デンマーク・クローネ＝17.84円、1ノルウェー・クローネ＝13.58円、1スウェーデン・クローネ＝13.38円、1ユーロ＝132.81円です。

(注3) 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（26,374,381千円）の投資信託財産総額（27,050,287千円）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

2017年11月30日現在

| 項 目                          | 当 期 末          |
|------------------------------|----------------|
| (A) 資産                       | 1,296,477,136円 |
| コール・ローン等                     | 2,124,643      |
| 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド(評価額) | 1,294,352,493  |
| (B) 負債                       | 1,815,286      |
| 未払解約金                        | 527,637        |
| 未払信託報酬                       | 1,266,950      |
| その他未払費用                      | 20,699         |
| (C) 純資産総額(A－B)               | 1,294,661,850  |
| 元本                           | 1,139,363,470  |
| 次期繰越損益金                      | 155,298,380    |
| (D) 受益権総口数                   | 1,139,363,470口 |
| 1万口当り基準価額(C／D)               | 11,363円        |

\* 設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は1,218,074,496円、同解約元本額は79,711,026円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,363円です。

■損益の状況

当期 自2017年1月11日 至2017年11月30日

| 項 目                  | 当 期           |
|----------------------|---------------|
| (A) 配当等収益            | △ 433円        |
| 受取利息                 | 8             |
| 支払利息                 | △ 441         |
| (B) 有価証券売買損益         | 74,831,050    |
| 売買益                  | 78,013,493    |
| 売買損                  | △ 3,182,443   |
| (C) 信託報酬等            | △ 1,717,818   |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 73,112,799    |
| (E) 追加信託差損益金         | 82,185,581    |
| (配当等相当額)             | (△ 157)       |
| (売買損益相当額)            | ( 82,185,738) |
| (F) 合計(D + E)        | 155,298,380   |
| 次期繰越損益金(F)           | 155,298,380   |
| 追加信託差損益金             | 82,185,581    |
| (配当等相当額)             | (△ 157)       |
| (売買損益相当額)            | ( 82,185,738) |
| 分配準備積立金              | 73,113,232    |
| 繰越損益金                | △ 433         |

- (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「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■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        | 73,113,232     |
| (c) 収益調整金                  | 82,185,738     |
| (d) 分配準備積立金                | 0              |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 155,298,970    |
| (f) 分配金                    | 0              |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e − f)       | 155,298,970    |
| (h) 受益権総口数                 | 1,139,363,470口 |

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（2017年1月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017年11月30日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を42～57ページに併せて掲載いたしました。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの主要な売買銘柄  
株 式

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

| 買                          |       |         |         | 売                                  |       |        |         |
|----------------------------|-------|---------|---------|------------------------------------|-------|--------|---------|
| 銘柄                         | 株数    | 金額      | 平均単価    | 銘柄                                 | 株数    | 金額     | 平均単価    |
|                            | 千株    | 千円      | 円       |                                    | 千株    | 千円     | 円       |
| APPLE INC (アメリカ)           | 17.55 | 280,647 | 15,991  | YAHOO! INC (アメリカ)                  | 4.85  | 28,240 | 5,822   |
| MICROSOFT CORP (アメリカ)      | 25    | 189,181 | 7,567   | APPLE INC (アメリカ)                   | 1.6   | 28,079 | 17,549  |
| AMAZON.COM INC (アメリカ)      | 1.46  | 149,845 | 102,633 | SYNGENTA AG-REG (スイス)              | 0.535 | 27,684 | 51,746  |
| FACEBOOK INC-A (アメリカ)      | 8.5   | 139,479 | 16,409  | ACTELION LTD-REG (スイス)             | 0.625 | 19,908 | 31,853  |
| EXXON MOBIL CORP (アメリカ)    | 14.75 | 134,886 | 9,144   | BRITISH AMERICAN TOB-SP ADR (イギリス) | 2.681 | 19,286 | 7,193   |
| JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)   | 9.564 | 134,412 | 14,054  | JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)           | 1.2   | 18,047 | 15,039  |
| JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ) | 12.15 | 120,874 | 9,948   | MICROSOFT CORP (アメリカ)              | 1.95  | 16,649 | 8,537   |
| ALPHABET INC-CL C (アメリカ)   | 1.09  | 106,861 | 98,038  | FACEBOOK INC-A (アメリカ)              | 0.85  | 16,465 | 19,371  |
| WELLS FARGO & CO (アメリカ)    | 16.6  | 102,426 | 6,170   | AMAZON.COM INC (アメリカ)              | 0.13  | 14,224 | 109,415 |
| ALPHABET INC-CL A (アメリカ)   | 1.02  | 101,859 | 99,862  | ENBRIDGE INC (カナダ)                 | 2.902 | 13,670 | 4,710   |

(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、2017年11月30日現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（14,973,926千円）の内容です。

(1) 外国株式

| 銘 柄                                | 2017年11月30日現在 |          |        | 業 種 等      |
|------------------------------------|---------------|----------|--------|------------|
|                                    | 株 数           | 評 価 額    |        |            |
|                                    |               | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |            |
| (アメリカ)                             | 百株            | 千アメリカ・ドル | 千円     |            |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 7.5           | 66       | 7,489  | 情報技術       |
| PALO ALTO NETWORKS INC             | 6             | 86       | 9,741  | 情報技術       |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC           | 3             | 41       | 4,634  | ヘルスケア      |
| SYNCHRONY FINANCIAL                | 51            | 180      | 20,200 | 金融         |
| ABBOTT LABORATORIES                | 112.2         | 623      | 69,875 | ヘルスケア      |
| ARCONIC INC                        | 24            | 57       | 6,472  | 資本財・サービス   |
| VERISK ANALYTICS INC               | 11.35         | 107      | 12,079 | 資本財・サービス   |
| LAS VEGAS SANDS CORP               | 24            | 162      | 18,168 | 一般消費財・サービス |
| AMPHENOL CORP-CL A                 | 19.5          | 175      | 19,614 | 情報技術       |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV        | 19.5          | 180      | 20,259 | 情報技術       |
| QORVO INC                          | 7             | 53       | 6,015  | 情報技術       |
| AFLAC INC                          | 25            | 217      | 24,424 | 金融         |
| DARDEN RESTAURANTS INC             | 8             | 67       | 7,602  | 一般消費財・サービス |
| ADOBE SYSTEMS INC                  | 31.5          | 557      | 62,420 | 情報技術       |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC         | 11            | 40       | 4,541  | 素材         |
| LULULEMON ATHLETICA INC            | 5.5           | 36       | 4,121  | 一般消費財・サービス |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL          | 19            | 36       | 4,100  | 金融         |
| GARMIN LTD                         | 7.5           | 46       | 5,243  | 一般消費財・サービス |

| 銘 柄                          | 2017年11月30日現在 |          |        | 業 種 等      |
|------------------------------|---------------|----------|--------|------------|
|                              | 株 数           | 評 価 額    |        |            |
|                              |               | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株            | 千アメリカ・ドル | 千円     |            |
| AETNA INC                    | 21.94         | 393      | 44,145 | ヘルスケア      |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 14            | 227      | 25,510 | 素材         |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 44.5          | 681      | 76,408 | 資本財・サービス   |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC    | 11.5          | 83       | 9,320  | 情報技術       |
| WR BERKLEY CORP              | 6             | 41       | 4,605  | 金融         |
| AUTOZONE INC                 | 1.9           | 130      | 14,666 | 一般消費財・サービス |
| DOLLAR TREE INC              | 15.99         | 166      | 18,658 | 一般消費財・サービス |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 56            | 84       | 9,456  | ヘルスケア      |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | 9             | 81       | 9,177  | 公益事業       |
| CELANESE CORP-SERIES A       | 9             | 96       | 10,778 | 素材         |
| DR HORTON INC                | 23.5          | 119      | 13,339 | 一般消費財・サービス |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 4.5           | 20       | 2,321  | エネルギー      |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 15.5          | 105      | 11,872 | ヘルスケア      |
| AUTODESK INC                 | 12.5          | 136      | 15,314 | 情報技術       |
| MOODY'S CORP                 | 10            | 149      | 16,789 | 金融         |
| DEVON ENERGY CORP            | 34            | 126      | 14,133 | エネルギー      |
| ALBEMARLE CORP               | 6             | 79       | 8,870  | 素材         |
| ATMOS ENERGY CORP            | 6             | 54       | 6,084  | 公益事業       |

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                            | 株数     | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|-------------------------------|--------|---------------|---------|------------|
|                               |        | 評価額           | 価額      |            |
|                               |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                               | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| ALLIANT ENERGY CORP           | 13     | 58            | 6,540   | 公益事業       |
| CITIGROUP INC                 | 171.8  | 1,289         | 144,453 | 金融         |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING     | 27.5   | 311           | 34,921  | 情報技術       |
| AMERICAN ELECTRIC POWER       | 32.5   | 250           | 28,091  | 公益事業       |
| ALLEGHANY CORP                | 0.8    | 46            | 5,237   | 金融         |
| DOMINO'S PIZZA INC            | 3      | 53            | 6,022   | 一般消費財・サービス |
| HESS CORP                     | 19.5   | 87            | 9,790   | エネルギー      |
| DAVITA INC                    | 10     | 60            | 6,794   | ヘルスケア      |
| DANAHER CORP                  | 41.3   | 387           | 43,472  | ヘルスケア      |
| FORTIVE CORP                  | 19     | 139           | 15,630  | 資本財・サービス   |
| AVNET INC                     | 11     | 45            | 5,083   | 情報技術       |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 36.25  | 253           | 28,351  | 金融         |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A      | 12     | 16            | 1,824   | 一般消費財・サービス |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C      | 17.01  | 20            | 2,321   | 一般消費財・サービス |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO     | 37.5   | 149           | 16,710  | 生活必需品      |
| BUNGE LTD                     | 9.5    | 63            | 7,070   | 生活必需品      |
| TE CONNECTIVITY LTD           | 24     | 226           | 25,345  | 情報技術       |
| APPLE INC                     | 331    | 5,609         | 628,576 | 情報技術       |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES   | 22     | 151           | 17,011  | 金融         |
| BOEING CO/THE                 | 36.5   | 982           | 110,138 | 資本財・サービス   |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP     | 9.5    | 71            | 7,969   | 金融         |
| BECTON DICKINSON AND CO       | 14.63  | 331           | 37,192  | ヘルスケア      |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR    | 15     | 38            | 4,344   | 一般消費財・サービス |
| LEIDOS HOLDINGS INC           | 8.5    | 53            | 5,942   | 情報技術       |
| CDK GLOBAL INC                | 11     | 75            | 8,505   | 情報技術       |
| NISOURCE INC                  | 20     | 54            | 6,088   | 公益事業       |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC   | 10.5   | 88            | 9,940   | 資本財・サービス   |
| CR BARD INC                   | 4.9    | 165           | 18,492  | ヘルスケア      |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP  | 65.5   | 356           | 39,932  | 金融         |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC    | 255.44 | 1,274         | 142,824 | 電気通信サービス   |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B   | 77.7   | 1,475         | 165,288 | 金融         |
| ANSYS INC                     | 4.5    | 65            | 7,390   | 情報技術       |
| H&R BLOCK INC                 | 16     | 41            | 4,637   | 一般消費財・サービス |
| BB&T CORP                     | 54     | 265           | 29,721  | 金融         |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO       | 105    | 660           | 74,003  | ヘルスケア      |
| JPMORGAN CHASE & CO           | 225.5  | 2,339         | 262,097 | 金融         |
| T ROWE PRICE GROUP INC        | 15.5   | 156           | 17,588  | 金融         |
| CIGNA CORP                    | 16.5   | 339           | 38,054  | ヘルスケア      |
| LKQ CORP                      | 20.5   | 80            | 9,073   | 一般消費財・サービス |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD      | 2      | 27            | 3,057   | 金融         |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B     | 14.5   | 85            | 9,618   | 生活必需品      |
| CADENCE DESIGN SYS INC        | 17     | 73            | 8,221   | 情報技術       |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC      | 9.5    | 155           | 17,410  | 金融         |
| DOLLAR GENERAL CORP           | 18.5   | 164           | 18,382  | 一般消費財・サービス |
| SERVICENOW INC                | 11.5   | 138           | 15,538  | 情報技術       |
| CATERPILLAR INC               | 38.5   | 531           | 59,558  | 資本財・サービス   |
| CMS ENERGY CORP               | 17     | 84            | 9,449   | 公益事業       |
| MOSAIC CO/THE                 | 15     | 36            | 4,099   | 素材         |
| DELTA AIR LINES INC           | 10     | 52            | 5,837   | 資本財・サービス   |
| CORNING INC                   | 59     | 191           | 21,472  | 情報技術       |
| CISCO SYSTEMS INC             | 320.5  | 1,201         | 134,598 | 情報技術       |
| MORGAN STANLEY                | 85.5   | 438           | 49,165  | 金融         |

| 銘柄                           | 株数    | 2017年11月30日現在 |        | 業種等        |
|------------------------------|-------|---------------|--------|------------|
|                              |       | 評価額           | 価額     |            |
|                              |       | 外貨建金額         | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株    | 千アメリカ・ドル      | 千円     |            |
| WABCO HOLDINGS INC           | 3.2   | 47            | 5,372  | 資本財・サービス   |
| MSCI INC                     | 7.3   | 93            | 10,447 | 金融         |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | 2.2   | 44            | 5,024  | 資本財・サービス   |
| MIDDLEBY CORP                | 4     | 50            | 5,616  | 資本財・サービス   |
| COTY INC-CL A                | 24.17 | 41            | 4,628  | 生活必需品      |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   | 10    | 40            | 4,592  | 情報技術       |
| BROADCOM LTD                 | 25.74 | 698           | 78,305 | 情報技術       |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     | 3     | 38            | 4,340  | ヘルスケア      |
| DICK'S SPORTING GOODS INC    | 2     | 5             | 660    | 一般消費財・サービス |
| ACUITY BRANDS INC            | 3.5   | 59            | 6,684  | 資本財・サービス   |
| ARAMARK                      | 17    | 72            | 8,110  | 一般消費財・サービス |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | 14    | 52            | 5,890  | 素材         |
| DTE ENERGY COMPANY           | 10.5  | 120           | 13,478 | 公益事業       |
| CENTENE CORP                 | 12    | 118           | 13,312 | ヘルスケア      |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 6     | 72            | 8,130  | 金融         |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 30.5  | 124           | 13,899 | 金融         |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | 12    | 79            | 8,930  | 金融         |
| GARTNER INC                  | 5     | 59            | 6,684  | 情報技術       |
| SPLUNK INC                   | 11    | 87            | 9,797  | 情報技術       |
| AGCO CORP                    | 5     | 35            | 3,972  | 資本財・サービス   |
| DOMINION ENERGY INC          | 40    | 336           | 37,648 | 公益事業       |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 27.5  | 170           | 19,070 | 生活必需品      |
| SMITH (A.O.) CORP            | 8     | 50            | 5,602  | 資本財・サービス   |
| DEERE & CO                   | 18.5  | 274           | 30,770 | 資本財・サービス   |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | 8.5   | 84            | 9,425  | 情報技術       |
| TIME WARNER INC              | 47.66 | 433           | 48,554 | 一般消費財・サービス |
| VMWARE INC-CLASS A           | 5     | 59            | 6,690  | 情報技術       |
| NASDAQ INC                   | 8.5   | 66            | 7,482  | 金融         |
| VAIL RESORTS INC             | 2.4   | 53            | 6,019  | 一般消費財・サービス |
| EAST WEST BANCORP INC        | 8.5   | 52            | 5,863  | 金融         |
| TARGA RESOURCES CORP         | 11    | 45            | 5,143  | エネルギー      |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 4.5   | 73            | 8,277  | 金融         |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 4.5   | 47            | 5,307  | 金融         |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 18.5  | 163           | 18,324 | 公益事業       |
| MEDNAX INC                   | 8     | 40            | 4,498  | ヘルスケア      |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP       | 7.5   | 84            | 9,434  | 一般消費財・サービス |
| TELEFLEX INC                 | 3     | 79            | 8,888  | ヘルスケア      |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 5     | 54            | 6,086  | 資本財・サービス   |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 6.5   | 38            | 4,288  | ヘルスケア      |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR | 7     | 46            | 5,165  | 資本財・サービス   |
| IDEX CORP                    | 4.5   | 59            | 6,680  | 資本財・サービス   |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 52.5  | 378           | 42,360 | 生活必需品      |
| ROLLINS INC                  | 7     | 32            | 3,616  | 資本財・サービス   |
| AMETEK INC                   | 14.75 | 105           | 11,846 | 資本財・サービス   |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 14    | 65            | 7,339  | 生活必需品      |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  | 10    | 41            | 4,678  | 資本財・サービス   |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 21    | 220           | 24,709 | 素材         |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 28    | 497           | 55,698 | 生活必需品      |
| SCANA CORP                   | 7     | 30            | 3,430  | 公益事業       |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    | 4     | 79            | 8,902  | 金融         |
| WR GRACE & CO                | 5.5   | 40            | 4,548  | 素材         |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 1.4   | 42            | 4,737  | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                            | 株数     | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|-------------------------------|--------|---------------|---------|------------|
|                               |        | 評価額           | 価額      |            |
|                               |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                               | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| LEUCADIA NATIONAL CORP        | 14     | 37            | 4,177   | 金融         |
| UGI CORP                      | 10     | 47            | 5,377   | 公益事業       |
| CUMMINS INC                   | 11     | 180           | 20,277  | 資本財・サービス   |
| ACTIVISION BLIZZARD INC       | 44.5   | 275           | 30,919  | 情報技術       |
| SABRE CORP                    | 16     | 31            | 3,553   | 情報技術       |
| CDW CORP/DE                   | 8      | 55            | 6,177   | 情報技術       |
| SIGNATURE BANK                | 3.5    | 48            | 5,440   | 金融         |
| COSTAR GROUP INC              | 2.5    | 75            | 8,455   | 情報技術       |
| SVB FINANCIAL GROUP           | 3      | 68            | 7,629   | 金融         |
| AMERCO                        | 0.7    | 25            | 2,883   | 資本財・サービス   |
| MERCADOLIBRE INC              | 2.8    | 74            | 8,398   | 情報技術       |
| HANESBRANDS INC               | 29     | 58            | 6,599   | 一般消費財・サービス |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC   | 4.5    | 51            | 5,743   | 情報技術       |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 10.83  | 82            | 9,290   | 一般消費財・サービス |
| COMMScope HOLDING CO INC      | 10.5   | 38            | 4,287   | 情報技術       |
| DEXCOM INC                    | 4      | 23            | 2,661   | ヘルスケア      |
| DIAMONDBACK ENERGY INC        | 6      | 64            | 7,270   | エネルギー      |
| SEATTLE GENETICS INC          | 4      | 23            | 2,650   | ヘルスケア      |
| ALIGN TECHNOLOGY INC          | 5      | 129           | 14,475  | ヘルスケア      |
| TRANSNIGM GROUP INC           | 3.5    | 97            | 10,954  | 資本財・サービス   |
| NIELSEN HOLDINGS PLC          | 25     | 90            | 10,174  | 資本財・サービス   |
| KINDER MORGAN INC             | 124.96 | 209           | 23,466  | エネルギー      |
| HCA HEALTHCARE INC            | 17.5   | 140           | 15,714  | ヘルスケア      |
| CABOT OIL & GAS CORP          | 29.5   | 86            | 9,642   | エネルギー      |
| T-MOBILE US INC               | 19.5   | 120           | 13,509  | 電気通信サービス   |
| ZILLOW GROUP INC - C          | 7      | 28            | 3,205   | 情報技術       |
| COCA-COLA CO/THE              | 253    | 1,151         | 128,986 | 生活必需品      |
| EXPEDITORS INTL WASH INC      | 12.5   | 80            | 9,021   | 資本財・サービス   |
| EATON VANCE CORP              | 6      | 32            | 3,672   | 金融         |
| FRANKLIN RESOURCES INC        | 22     | 94            | 10,631  | 金融         |
| CSX CORP                      | 58     | 315           | 35,380  | 資本財・サービス   |
| FLUOR CORP                    | 7      | 33            | 3,780   | 資本財・サービス   |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS  | 5.5    | 86            | 9,676   | ヘルスケア      |
| EXPEDIA INC                   | 8      | 97            | 10,937  | 一般消費財・サービス |
| AUTOLIV INC                   | 5.5    | 69            | 7,815   | 一般消費財・サービス |
| AMAZON.COM INC                | 26     | 3,019         | 338,312 | 一般消費財・サービス |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A    | 16     | 42            | 4,725   | エネルギー      |
| FLOWERVE CORP                 | 9      | 37            | 4,186   | 資本財・サービス   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP     | 13     | 151           | 16,951  | ヘルスケア      |
| EXXON MOBIL CORP              | 269.26 | 2,215         | 248,213 | エネルギー      |
| FLIR SYSTEMS INC              | 8      | 37            | 4,173   | 情報技術       |
| AES CORP                      | 40     | 42            | 4,755   | 公益事業       |
| L3 TECHNOLOGIES INC           | 4.5    | 88            | 9,905   | 資本財・サービス   |
| EVEREST RE GROUP LTD          | 2      | 44            | 4,991   | 金融         |
| EOG RESOURCES INC             | 36.5   | 366           | 41,102  | エネルギー      |
| EQT CORP                      | 10     | 58            | 6,511   | エネルギー      |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC       | 12.5   | 69            | 7,751   | 情報技術       |
| AMERISOURCEBERGEN CORP        | 10     | 84            | 9,486   | ヘルスケア      |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC      | 19.5   | 133           | 15,008  | ヘルスケア      |
| FORD MOTOR CO                 | 247.5  | 310           | 34,831  | 一般消費財・サービス |
| TESARO INC                    | 2      | 16            | 1,861   | ヘルスケア      |
| MACY'S INC                    | 22     | 52            | 5,911   | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                            | 株数    | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|-------------------------------|-------|---------------|---------|------------|
|                               |       | 評価額           | 価額      |            |
|                               |       | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                               | 百株    | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A    | 11    | 20            | 2,325   | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A          | 12.16 | 39            | 4,398   | 一般消費財・サービス |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C    | 12.5  | 22            | 2,490   | 一般消費財・サービス |
| AERCAP HOLDINGS NV            | 8.5   | 43            | 4,927   | 資本財・サービス   |
| FORTINET INC                  | 10.5  | 43            | 4,875   | 情報技術       |
| MARKEL CORP                   | 0.8   | 88            | 9,893   | 金融         |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A    | 8     | 15            | 1,762   | エネルギー      |
| NEXTERA ENERGY INC            | 30.8  | 485           | 54,448  | 公益事業       |
| FREEMPORT-MCMORAN INC         | 94.5  | 132           | 14,834  | 素材         |
| US BANCORP                    | 104   | 569           | 63,812  | 金融         |
| UNITED RENTALS INC            | 4.5   | 71            | 7,958   | 資本財・サービス   |
| F5 NETWORKS INC               | 3     | 38            | 4,365   | 情報技術       |
| FASTENAL CO                   | 20.5  | 105           | 11,769  | 資本財・サービス   |
| FISERV INC                    | 12.5  | 160           | 18,028  | 情報技術       |
| GENERAL ELECTRIC CO           | 541.5 | 1,000         | 112,127 | 資本財・サービス   |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING | 12.5  | 69            | 7,744   | 一般消費財・サービス |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO     | 11.5  | 36            | 4,141   | 一般消費財・サービス |
| GENERAL MOTORS CO             | 89    | 389           | 43,689  | 一般消費財・サービス |
| TRIPADVISOR INC               | 7     | 24            | 2,711   | 一般消費財・サービス |
| GENERAL DYNAMICS CORP         | 16    | 326           | 36,603  | 資本財・サービス   |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC       | 22.6  | 545           | 61,120  | 金融         |
| ALPHABET INC-CL A             | 19    | 1,971         | 220,853 | 情報技術       |
| ALPHABET INC-CL C             | 19.91 | 2,034         | 227,923 | 情報技術       |
| GENERAL MILLS INC             | 37.5  | 211           | 23,673  | 生活必需品      |
| FIRSTENERGY CORP              | 30.17 | 101           | 11,382  | 公益事業       |
| GENUINE PARTS CO              | 8     | 73            | 8,202   | 一般消費財・サービス |
| IHS MARKIT LTD                | 26.05 | 115           | 12,889  | 資本財・サービス   |
| FIFTH THIRD BANCORP           | 45.5  | 138           | 15,529  | 金融         |
| HARRIS CORP                   | 3.72  | 107           | 12,035  | 情報技術       |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC   | 9.5   | 46            | 5,242   | 資本財・サービス   |
| HALLIBURTON CO                | 59.5  | 245           | 27,534  | エネルギー      |
| HOME DEPOT INC                | 77    | 1,364         | 152,928 | 一般消費財・サービス |
| ASSURANT INC                  | 2.5   | 25            | 2,849   | 金融         |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC     | 76.5  | 110           | 12,412  | 金融         |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE  | 3.5   | 83            | 9,399   | 資本財・サービス   |
| HERSHEY CO/THE                | 9.5   | 104           | 11,762  | 生活必需品      |
| HARLEY-DAVIDSON INC           | 14    | 68            | 7,683   | 一般消費財・サービス |
| HUMANA INC                    | 9.5   | 237           | 26,625  | ヘルスケア      |
| NXP SEMICONDUCTORS NV         | 20.5  | 231           | 25,956  | 情報技術       |
| HELMERICH & PAYNE             | 6     | 34            | 3,834   | エネルギー      |
| HENRY SCHEIN INC              | 11    | 77            | 8,664   | ヘルスケア      |
| HP INC                        | 107.5 | 230           | 25,813  | 情報技術       |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE    | 102.5 | 143           | 16,044  | 情報技術       |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C  | 11    | 44            | 5,041   | 一般消費財・サービス |
| HOLLYFRONTIER CORP            | 11    | 48            | 5,463   | エネルギー      |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A  | 8.5   | 34            | 3,886   | 一般消費財・サービス |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD        | 8     | 76            | 8,626   | 金融         |
| KRAFT HEINZ CO/THE            | 40    | 324           | 36,344  | 生活必需品      |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP   | 57.5  | 882           | 98,930  | 情報技術       |
| INTERNATIONAL PAPER CO        | 23.5  | 130           | 14,619  | 素材         |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI  | 9     | 60            | 6,743   | 資本財・サービス   |
| ZOETIS INC                    | 30.5  | 218           | 24,472  | ヘルスケア      |



# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 株数     | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|--------|---------------|---------|------------|
|                              |        | 評価額           | 価額      |            |
|                              |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| INGERSOLL-RAND PLC           | 16.65  | 143           | 16,057  | 資本財・サービス   |
| CHENIERE ENERGY INC          | 10     | 48            | 5,378   | エネルギー      |
| ALLEGION PLC                 | 5.5    | 45            | 5,111   | 資本財・サービス   |
| LEGGETT & PLATT INC          | 6.5    | 31            | 3,503   | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C        | 35.86  | 112           | 12,564  | 一般消費財・サービス |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 15     | 103           | 11,613  | 資本財・サービス   |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 28.5   | 84            | 9,455   | 情報技術       |
| JM SMUCKER CO/THE            | 6      | 70            | 7,910   | 生活必需品      |
| JOHNSON & JOHNSON            | 169.64 | 2,371         | 265,753 | ヘルスケア      |
| ABBVIE INC                   | 102.66 | 983           | 110,222 | ヘルスケア      |
| HOLOGIC INC                  | 18     | 76            | 8,525   | ヘルスケア      |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 23     | 274           | 30,704  | 生活必需品      |
| KROGER CO                    | 56     | 136           | 15,297  | 生活必需品      |
| KLA-TENCOR CORP              | 11     | 110           | 12,368  | 情報技術       |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 16.7   | 535           | 60,021  | 資本財・サービス   |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC    | 5.3    | 95            | 10,661  | 情報技術       |
| L BRANDS INC                 | 13.5   | 70            | 7,946   | 一般消費財・サービス |
| LOWE'S COS INC               | 54     | 449           | 50,402  | 一般消費財・サービス |
| ELI LILLY & CO               | 61     | 518           | 58,070  | ヘルスケア      |
| LAM RESEARCH CORP            | 10.5   | 204           | 22,899  | 情報技術       |
| RANGE RESOURCES CORP         | 10     | 18            | 2,016   | エネルギー      |
| JONES LANG LASALLE INC       | 3      | 45            | 5,098   | 不動産        |
| LOEWS CORP                   | 18     | 90            | 10,151  | 金融         |
| MCDONALD NATIONAL CORP       | 13     | 99            | 11,150  | 金融         |
| MC DONALD'S CORP             | 52     | 886           | 99,302  | 一般消費財・サービス |
| 3M CO                        | 38.5   | 916           | 102,675 | 資本財・サービス   |
| FACEBOOK INC-A               | 149    | 2,609         | 292,387 | 情報技術       |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V   | 12.17  | 94            | 10,635  | 情報技術       |
| MANPOWERGROUP INC            | 3.5    | 45            | 5,090   | 資本財・サービス   |
| S&P GLOBAL INC               | 16.9   | 278           | 31,194  | 金融         |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 3.5    | 72            | 8,177   | 素材         |
| CONCHO RESOURCES INC         | 9.5    | 130           | 14,637  | エネルギー      |
| ENVISION HEALTHCARE CORP     | 5.33   | 16            | 1,900   | ヘルスケア      |
| FIRST DATA CORP- CLASS A     | 38.5   | 62            | 6,975   | 情報技術       |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC      | 8      | 28            | 3,168   | 電気通信サービス   |
| PHILLIPS 66                  | 25.97  | 246           | 27,618  | エネルギー      |
| MURPHY OIL CORP              | 12.6   | 35            | 3,970   | エネルギー      |
| TECHNIPFMC PLC               | 29     | 79            | 8,958   | エネルギー      |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 28     | 94            | 10,557  | 一般消費財・サービス |
| MATTEL INC                   | 14     | 25            | 2,861   | 一般消費財・サービス |
| DXC TECHNOLOGY CO            | 16.88  | 161           | 18,066  | 情報技術       |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 7      | 71            | 8,009   | 生活必需品      |
| MYLAN NV                     | 26.5   | 97            | 10,944  | ヘルスケア      |
| METLIFE INC                  | 59     | 315           | 35,401  | 金融         |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 22     | 48            | 5,474   | 情報技術       |
| ARISTA NETWORKS INC          | 2.5    | 58            | 6,560   | 情報技術       |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A   | 5      | 24            | 2,788   | 金融         |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 10.85  | 102           | 11,448  | 情報技術       |
| MONSANTO CO                  | 27.5   | 323           | 36,270  | 素材         |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 1.5    | 93            | 10,512  | ヘルスケア      |
| BAKER HUGHES A GE CO         | 23.31  | 69            | 7,830   | エネルギー      |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 7.5    | 142           | 15,978  | 資本財・サービス   |

| 銘柄                           | 株数     | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|--------|---------------|---------|------------|
|                              |        | 評価額           | 価額      |            |
|                              |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC    | 5.36   | 31            | 3,569   | 金融         |
| MERCK & CO. INC.             | 175.37 | 970           | 108,783 | ヘルスケア      |
| DOWDUPONT INC                | 150.3  | 1,078         | 120,885 | 素材         |
| MASCO CORP                   | 22     | 92            | 10,360  | 資本財・サービス   |
| M & T BANK CORP              | 8.32   | 140           | 15,765  | 金融         |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 31     | 259           | 29,038  | 金融         |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 19.45  | 246           | 27,566  | 一般消費財・サービス |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 8      | 85            | 9,550   | 情報技術       |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD    | 11     | 64            | 7,228   | 一般消費財・サービス |
| VANTIV INC - CL A            | 8.6    | 62            | 6,962   | 情報技術       |
| NETAPP INC                   | 16     | 89            | 10,080  | 情報技術       |
| NIKE INC -CL B               | 83     | 500           | 56,135  | 一般消費財・サービス |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 19     | 259           | 29,041  | 資本財・サービス   |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 16.5   | 142           | 16,007  | 情報技術       |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 10.5   | 92            | 10,400  | 金融         |
| ALLY FINANCIAL INC           | 33     | 87            | 9,857   | 金融         |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 10.5   | 322           | 36,082  | 資本財・サービス   |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC        | 16     | 163           | 18,295  | 一般消費財・サービス |
| NEWMONT MINING CORP          | 31.5   | 115           | 12,918  | 素材         |
| MCKESSON CORP                | 12.5   | 185           | 20,746  | ヘルスケア      |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 18     | 93            | 10,510  | 情報技術       |
| XYLEM INC                    | 13     | 88            | 9,934   | 資本財・サービス   |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 99.5   | 1,021         | 114,477 | 生活必需品      |
| NUCOR CORP                   | 21.5   | 123           | 13,818  | 素材         |
| WESTERN UNION CO             | 36     | 70            | 7,946   | 情報技術       |
| NEWELL BRANDS INC            | 27.58  | 84            | 9,428   | 一般消費財・サービス |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 45.5   | 318           | 35,636  | エネルギー      |
| LIBERTY BROADBAND-C          | 8      | 70            | 7,872   | 一般消費財・サービス |
| SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC | 2      | 23            | 2,578   | 生活必需品      |
| PAYCHEX INC                  | 21.5   | 143           | 16,039  | 情報技術       |
| PATTERSON COS INC            | 3      | 11            | 1,242   | ヘルスケア      |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 5.5    | 129           | 14,563  | 一般消費財・サービス |
| ALTRIA GROUP INC             | 120    | 808           | 90,585  | 生活必需品      |
| P G & E CORP                 | 33     | 181           | 20,359  | 公益事業       |
| PFIZER INC                   | 373.58 | 1,352         | 151,573 | ヘルスケア      |
| ALKERMES PLC                 | 10.5   | 54            | 6,053   | ヘルスケア      |
| XCEL ENERGY INC              | 31.5   | 161           | 18,092  | 公益事業       |
| STRYKER CORP                 | 21     | 323           | 36,260  | ヘルスケア      |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 7.7    | 141           | 15,902  | 資本財・サービス   |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 11.5   | 173           | 19,478  | エネルギー      |
| POLARIS INDUSTRIES INC       | 4      | 51            | 5,784   | 一般消費財・サービス |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 164.7  | 1,472         | 164,947 | 生活必需品      |
| EXELON CORP                  | 59.54  | 248           | 27,813  | 公益事業       |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 14     | 150           | 16,843  | ヘルスケア      |
| NVR INC                      | 0.2    | 69            | 7,772   | 一般消費財・サービス |
| CONOCOPHILLIPS               | 75.5   | 383           | 42,916  | エネルギー      |
| PEPSICO INC                  | 91.85  | 1,073         | 120,249 | 生活必需品      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 26     | 301           | 33,756  | 金融         |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 13.5   | 121           | 13,667  | 公益事業       |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 39.5   | 580           | 65,039  | 情報技術       |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD    | 6      | 32            | 3,600   | 金融         |
| PENTAIR PLC                  | 10.25  | 71            | 7,961   | 資本財・サービス   |

| 銘柄                           | 株数    | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|-------|---------------|---------|------------|
|                              |       | 評価額           | 価額      |            |
|                              |       | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株    | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| QUALCOMM INC                 | 94.5  | 628           | 70,436  | 情報技術       |
| INVESCO LTD                  | 25.5  | 92            | 10,314  | 金融         |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 5     | 49            | 5,599   | 一般消費財・サービス |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 18    | 128           | 14,428  | 金融         |
| RAYTHEON COMPANY             | 19.5  | 367           | 41,204  | 資本財・サービス   |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A  | 4.5   | 36            | 4,102   | 一般消費財・サービス |
| RED HAT INC                  | 12.8  | 159           | 17,854  | 情報技術       |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 5     | 179           | 20,092  | ヘルスケア      |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 15    | 96            | 10,808  | 資本財・サービス   |
| PRICELINE GROUP INC/THE      | 3.2   | 555           | 62,190  | 一般消費財・サービス |
| ROSS STORES INC              | 26    | 197           | 22,126  | 一般消費財・サービス |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 5.5   | 63            | 7,092   | 素材         |
| RESMED INC                   | 9.5   | 80            | 9,074   | ヘルスケア      |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 8.5   | 82            | 9,269   | ヘルスケア      |
| ROBERT HALF INTL INC         | 8     | 45            | 5,093   | 資本財・サービス   |
| RALPH LAUREN CORP            | 4     | 37            | 4,242   | 一般消費財・サービス |
| AUTONATION INC               | 6.5   | 35            | 4,032   | 一般消費財・サービス |
| ROCKWELL COLLINS INC         | 10.51 | 138           | 15,542  | 資本財・サービス   |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 69.5  | 115           | 12,903  | 金融         |
| CHEVRON CORP                 | 121.5 | 1,423         | 159,529 | エネルギー      |
| EDISON INTERNATIONAL         | 19    | 154           | 17,331  | 公益事業       |
| TESLA INC                    | 8.3   | 255           | 28,601  | 一般消費財・サービス |
| SYMANTEC CORP                | 39.5  | 112           | 12,645  | 情報技術       |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 10.02 | 167           | 18,818  | 資本財・サービス   |
| SYNOPSIS INC                 | 8     | 69            | 7,778   | 情報技術       |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 13.23 | 438           | 49,167  | 一般消費財・サービス |
| CBRE GROUP INC - A           | 20    | 85            | 9,634   | 不動産        |
| TWITTER INC                  | 38    | 79            | 8,852   | 情報技術       |
| SOUTHERN CO/THE              | 62    | 316           | 35,492  | 公益事業       |
| SYSCO CORP                   | 30.5  | 175           | 19,719  | 生活必需品      |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 17    | 228           | 25,625  | 金融         |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 10    | 69            | 7,818   | 金融         |
| STERICYCLE INC               | 5     | 32            | 3,657   | 資本財・サービス   |
| STEEL DYNAMICS INC           | 13    | 49            | 5,516   | 素材         |
| SCHLUMBERGER LTD             | 87.93 | 546           | 61,233  | エネルギー      |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 10.5  | 52            | 5,901   | 資本財・サービス   |
| AT&T INC                     | 395.7 | 1,443         | 161,745 | 電気通信サービス   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        | 9     | 52            | 5,937   | 資本財・サービス   |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 5.4   | 212           | 23,837  | 素材         |
| SEMPRA ENERGY                | 14    | 168           | 18,865  | 公益事業       |
| TIFFANY & CO                 | 7.5   | 69            | 7,777   | 一般消費財・サービス |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 17    | 65            | 7,381   | 情報技術       |
| TEXAS INSTRUMENTS INC        | 61.5  | 595           | 66,760  | 情報技術       |
| SALESFORCE.COM INC           | 42.5  | 440           | 49,302  | 情報技術       |
| SIGNET JEWELERS LTD          | 4     | 20            | 2,347   | 一般消費財・サービス |
| WESTROCK CO                  | 17.12 | 103           | 11,559  | 素材         |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 60.53 | 230           | 25,834  | 資本財・サービス   |
| ANDEAVOR                     | 10.5  | 110           | 12,371  | エネルギー      |
| UNION PACIFIC CORP           | 50    | 614           | 68,877  | 資本財・サービス   |
| MARATHON OIL CORP            | 61    | 89            | 10,081  | エネルギー      |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 35.5  | 217           | 24,423  | エネルギー      |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP     | 49.5  | 584           | 65,537  | 資本財・サービス   |

| 銘柄                           | 株数     | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|--------|---------------|---------|------------|
|                              |        | 評価額           | 価額      |            |
|                              |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 45     | 535           | 60,022  | 資本財・サービス   |
| UNUM GROUP                   | 12     | 67            | 7,586   | 金融         |
| SPRINT CORP                  | 41.14  | 24            | 2,798   | 電気通信サービス   |
| ANTERO RESOURCES CORP        | 10     | 18            | 2,102   | エネルギー      |
| IQVIA HOLDINGS INC           | 9.53   | 96            | 10,818  | ヘルスケア      |
| VOYA FINANCIAL INC           | 11     | 48            | 5,414   | 金融         |
| AMEREN CORPORATION           | 12.5   | 79            | 8,919   | 公益事業       |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 61.6   | 1,372         | 153,838 | ヘルスケア      |
| VERISIGN INC                 | 7.5    | 86            | 9,642   | 情報技術       |
| VALERO ENERGY CORP           | 27     | 225           | 25,213  | エネルギー      |
| ULTA BEAUTY INC              | 3.3    | 73            | 8,249   | 一般消費財・サービス |
| FNF GROUP                    | 17.5   | 70            | 7,884   | 金融         |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 6      | 64            | 7,225   | ヘルスケア      |
| ANTHEM INC                   | 16.5   | 375           | 42,025  | ヘルスケア      |
| WALT DISNEY CO/THE           | 97.5   | 1,026         | 114,973 | 一般消費財・サービス |
| WELLS FARGO & CO             | 303.87 | 1,722         | 192,987 | 金融         |
| FOOT LOCKER INC              | 7      | 29            | 3,340   | 一般消費財・サービス |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 27.5   | 227           | 25,458  | 資本財・サービス   |
| WILLIAMS COS INC             | 48     | 135           | 15,231  | エネルギー      |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 10.5   | 72            | 8,160   | 一般消費財・サービス |
| WHIRLPOOL CORP               | 5      | 84            | 9,467   | 一般消費財・サービス |
| WAL-MART STORES INC          | 98     | 956           | 107,129 | 生活必需品      |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 12.5   | 145           | 16,320  | ヘルスケア      |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PL | 64     | 20            | 2,309   | エネルギー      |
| WYNN RESORTS LTD             | 5      | 78            | 8,743   | 一般消費財・サービス |
| XEROX CORP                   | 9.39   | 27            | 3,082   | 情報技術       |
| WABTEC CORP                  | 5      | 38            | 4,313   | 資本財・サービス   |
| TJX COMPANIES INC            | 40.5   | 302           | 33,935  | 一般消費財・サービス |
| WATERS CORP                  | 4.5    | 88            | 9,866   | ヘルスケア      |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS  | 3.5    | 21            | 2,435   | 資本財・サービス   |
| ALLERGAN PLC                 | 21.49  | 377           | 42,305  | ヘルスケア      |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 56     | 402           | 45,128  | 生活必需品      |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 8.13   | 129           | 14,490  | 金融         |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 16.95  | 137           | 15,383  | 情報技術       |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 22     | 152           | 17,073  | 公益事業       |
| WESTAR ENERGY INC            | 9      | 50            | 5,676   | 公益事業       |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 35     | 184           | 20,667  | 公益事業       |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 115.5  | 1,268         | 142,178 | 情報技術       |
| PPL CORP                     | 46     | 168           | 18,869  | 公益事業       |
| PULTEGROUP INC               | 19     | 64            | 7,197   | 一般消費財・サービス |
| PPG INDUSTRIES INC           | 17.1   | 200           | 22,419  | 素材         |
| NORTHERN TRUST CORP          | 12.5   | 122           | 13,759  | 金融         |
| NVIDIA CORP                  | 38     | 746           | 83,633  | 情報技術       |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 30.53  | 426           | 47,800  | 金融         |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A | 29     | 70            | 7,951   | 一般消費財・サービス |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC       | 12     | 43            | 4,913   | 資本財・サービス   |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 19.5   | 159           | 17,921  | 生活必需品      |
| NETFLIX INC                  | 28     | 526           | 59,030  | 一般消費財・サービス |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 25.6   | 493           | 55,252  | ヘルスケア      |
| TORCHMARK CORP               | 6.5    | 57            | 6,488   | 金融         |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 9      | 86            | 9,729   | 金融         |
| TEXTRON INC                  | 16     | 87            | 9,831   | 資本財・サービス   |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 株数     | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|--------|---------------|---------|------------|
|                              |        | 評価額           | 価額      |            |
|                              |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株     | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A   | 66.5   | 213           | 23,918  | 一般消費財・サービス |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B | 32     | 100           | 11,222  | 一般消費財・サービス |
| NEWS CORP - CLASS A          | 29     | 47            | 5,312   | 一般消費財・サービス |
| OGE ENERGY CORP              | 12     | 42            | 4,743   | 公益事業       |
| OMNICOM GROUP                | 13.5   | 98            | 11,031  | 一般消費財・サービス |
| ORACLE CORP                  | 197    | 955           | 107,102 | 情報技術       |
| MASTERCARD INC - A           | 61     | 904           | 101,397 | 情報技術       |
| ONEOK INC                    | 22.5   | 113           | 12,714  | エネルギー      |
| CENTURYLINK INC              | 54.39  | 79            | 8,861   | 電気通信サービス   |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 6      | 157           | 17,630  | 資本財・サービス   |
| YUM! BRANDS INC              | 21     | 171           | 19,250  | 一般消費財・サービス |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 4      | 93            | 10,452  | 情報技術       |
| MOLSON COORS BREWING CO-B    | 12.5   | 95            | 10,717  | 生活必需品      |
| NOBLE ENERGY INC             | 24.5   | 63            | 7,112   | エネルギー      |
| BANK OF AMERICA CORP         | 633.63 | 1,791         | 200,783 | 金融         |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 11     | 91            | 10,263  | ヘルスケア      |
| NORDSTROM INC                | 8      | 36            | 4,101   | 一般消費財・サービス |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 48.5   | 468           | 52,496  | 金融         |
| ANALOG DEVICES INC           | 23.44  | 200           | 22,498  | 情報技術       |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 58     | 62            | 7,038   | 情報技術       |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 17.08  | 86            | 9,735   | 金融         |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 61.7   | 372           | 41,688  | 金融         |
| ANADARKO PETROLEUM CORP      | 35     | 167           | 18,777  | エネルギー      |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 12     | 126           | 14,162  | 情報技術       |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 11     | 137           | 15,369  | 一般消費財・サービス |
| NEWFIELD EXPLORATION CO      | 12     | 36            | 4,047   | エネルギー      |
| MALLINCKRODT PLC             | 7      | 15            | 1,735   | ヘルスケア      |
| AVERY DENNISON CORP          | 6.5    | 72            | 8,148   | 素材         |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 38     | 274           | 30,703  | 情報技術       |
| EMERSON ELECTRIC CO          | 39     | 249           | 27,910  | 資本財・サービス   |
| AON PLC                      | 17     | 238           | 26,757  | 金融         |
| AMGEN INC                    | 47.5   | 818           | 91,667  | ヘルスケア      |
| CORE LABORATORIES N.V.       | 4      | 39            | 4,463   | エネルギー      |
| TAPESTRY INC                 | 18     | 74            | 8,372   | 一般消費財・サービス |
| EATON CORP PLC               | 26.62  | 204           | 22,919  | 資本財・サービス   |
| CELGENE CORP                 | 48.5   | 500           | 56,039  | ヘルスケア      |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 11.5   | 246           | 27,621  | 生活必需品      |
| APPLIED MATERIALS INC        | 69.1   | 365           | 40,966  | 情報技術       |
| CIT GROUP INC                | 9      | 44            | 5,014   | 金融         |
| CIMAREX ENERGY CO            | 5      | 57            | 6,399   | エネルギー      |
| CME GROUP INC                | 23     | 340           | 38,098  | 金融         |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 21.89  | 71            | 7,998   | エネルギー      |
| ECOLAB INC                   | 17     | 229           | 25,715  | 素材         |
| EQUIFAX INC                  | 8.5    | 95            | 10,729  | 資本財・サービス   |
| GAP INC/THE                  | 13     | 42            | 4,734   | 一般消費財・サービス |
| GILEAD SCIENCES INC          | 85     | 626           | 70,165  | ヘルスケア      |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC  | 10.76  | 96            | 10,785  | 生活必需品      |
| HORMEL FOODS CORP            | 22     | 79            | 8,871   | 生活必需品      |
| STATE STREET CORP            | 22.5   | 213           | 23,870  | 金融         |
| SUNTRUST BANKS INC           | 34     | 208           | 23,353  | 金融         |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 74     | 358           | 40,148  | 金融         |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 29.5   | 192           | 21,545  | ヘルスケア      |

| 銘柄                           | 株数    | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|-------|---------------|---------|------------|
|                              |       | 評価額           | 価額      |            |
|                              |       | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株    | 千アメリカ・ドル      | 千円      |            |
| CAMPBELL SOUP CO             | 13    | 63            | 7,136   | 生活必需品      |
| CROWN HOLDINGS INC           | 8     | 47            | 5,308   | 素材         |
| CARDINAL HEALTH INC          | 18.5  | 109           | 12,253  | ヘルスケア      |
| FEDEX CORP                   | 16.4  | 370           | 41,517  | 資本財・サービス   |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 30    | 272           | 30,579  | 金融         |
| FMC CORP                     | 7.5   | 69            | 7,833   | 素材         |
| FLEX LTD                     | 45    | 81            | 9,131   | 情報技術       |
| CERNER CORP                  | 18.5  | 129           | 14,462  | ヘルスケア      |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 6.5   | 100           | 11,256  | 素材         |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 9.5   | 82            | 9,260   | 情報技術       |
| INTEL CORP                   | 301.5 | 1,325         | 148,476 | 情報技術       |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 28    | 56            | 6,290   | 一般消費財・サービス |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 22    | 126           | 14,211  | 金融         |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 20    | 331           | 37,173  | 資本財・サービス   |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 80    | 43            | 4,912   | 一般消費財・サービス |
| ILLUMINA INC                 | 9.1   | 207           | 23,195  | ヘルスケア      |
| SEALED AIR CORP              | 14.5  | 68            | 7,691   | 素材         |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 7.5   | 295           | 33,135  | ヘルスケア      |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 8.5   | 86            | 9,720   | 情報技術       |
| SNAP-ON INC                  | 3     | 50            | 5,621   | 資本財・サービス   |
| CARMAX INC                   | 12    | 82            | 9,210   | 一般消費財・サービス |
| COMERICA INC                 | 11    | 91            | 10,290  | 金融         |
| INGREDION INC                | 5.3   | 74            | 8,299   | 生活必需品      |
| DUKE ENERGY CORP             | 44.38 | 394           | 44,257  | 公益事業       |
| TARGET CORP                  | 31    | 191           | 21,424  | 一般消費財・サービス |
| DOVER CORP                   | 8.5   | 81            | 9,129   | 資本財・サービス   |
| VWV GRAINGER INC             | 4     | 86            | 9,715   | 資本財・サービス   |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 6     | 38            | 4,358   | 資本財・サービス   |
| CINTAS CORP                  | 5.5   | 84            | 9,473   | 資本財・サービス   |
| CA INC                       | 22    | 71            | 8,031   | 情報技術       |
| CONAGRA BRANDS INC           | 25    | 93            | 10,420  | 生活必需品      |
| CLOROX COMPANY               | 9     | 125           | 14,039  | 生活必需品      |
| ENTERGY CORP                 | 11    | 94            | 10,618  | 公益事業       |
| MICROSOFT CORP               | 462.5 | 3,854         | 431,893 | 情報技術       |
| INCYTE CORP                  | 10.5  | 100           | 11,289  | ヘルスケア      |
| CVS HEALTH CORP              | 64.5  | 473           | 53,047  | 生活必需品      |
| MEDTRONIC PLC                | 88.56 | 727           | 81,478  | ヘルスケア      |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 67.5  | 295           | 33,082  | 情報技術       |
| BLACKROCK INC                | 7.6   | 380           | 42,648  | 金融         |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 29    | 86            | 9,641   | 公益事業       |
| HASBRO INC                   | 6     | 55            | 6,241   | 一般消費財・サービス |
| KELLOGG CO                   | 14.5  | 96            | 10,853  | 生活必需品      |
| KEYCORP                      | 71    | 134           | 15,123  | 金融         |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 7.5   | 82            | 9,254   | 資本財・サービス   |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 95    | 407           | 45,708  | 生活必需品      |
| KOHL'S CORP                  | 8.5   | 40            | 4,543   | 一般消費財・サービス |
| COOPER COS INC/THE           | 3.5   | 84            | 9,513   | ヘルスケア      |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP   | 23    | 31            | 3,473   | 金融         |
| APACHE CORP                  | 25    | 101           | 11,412  | エネルギー      |
| CHUBB LTD                    | 30.6  | 467           | 52,336  | 金融         |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 4.5   | 36            | 4,049   | 情報技術       |
| ALLSTATE CORP                | 25    | 254           | 28,561  | 金融         |

| 銘柄                           | 株数               | 2017年11月30日現在      |                    | 業種等        |
|------------------------------|------------------|--------------------|--------------------|------------|
|                              |                  | 評価額                | 価額                 |            |
|                              |                  | 外貨建金額              | 邦貨換算金額             |            |
|                              | 百株               | 千アメリカ・ドル           | 千円                 |            |
| EBAY INC                     | 66.5             | 228                | 25,617             | 情報技術       |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 70.5             | 516                | 57,864             | 情報技術       |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 9                | 82                 | 9,218              | 素材         |
| XILINX INC                   | 16.5             | 114                | 12,827             | 情報技術       |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO   | 37.85            | 237                | 26,659             | ヘルスケア      |
| DISH NETWORK CORP-A          | 15               | 76                 | 8,618              | 一般消費財・サービス |
| ZIONS BANCORPORATION         | 12               | 59                 | 6,654              | 金融         |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 14.5             | 179                | 20,135             | 生活必需品      |
| TOLL BROTHERS INC            | 12               | 60                 | 6,735              | 一般消費財・サービス |
| TRIMBLE INC                  | 13               | 53                 | 6,036              | 情報技術       |
| LENNAR CORP-A                | 14               | 87                 | 9,754              | 一般消費財・サービス |
| LEAR CORP                    | 4                | 71                 | 8,027              | 一般消費財・サービス |
| E*TRADE FINANCIAL CORP       | 15               | 71                 | 8,030              | 金融         |
| PROGRESSIVE CORP             | 36.5             | 191                | 21,451             | 金融         |
| PRAXAIR INC                  | 18               | 279                | 31,296             | 素材         |
| PACCAR INC                   | 23               | 158                | 17,784             | 資本財・サービス   |
| PVH CORP                     | 5.5              | 75                 | 8,451              | 一般消費財・サービス |
| BIOGEN INC                   | 13.5             | 431                | 48,399             | ヘルスケア      |
| IDEXX LABORATORIES INC       | 5.5              | 84                 | 9,490              | ヘルスケア      |
| STARBUCKS CORP               | 88.5             | 508                | 57,029             | 一般消費財・サービス |
| PERRIGO CO PLC               | 9                | 78                 | 8,846              | ヘルスケア      |
| EVERSOURCE ENERGY            | 18.5             | 119                | 13,393             | 公益事業       |
| INTUIT INC                   | 16               | 246                | 27,648             | 情報技術       |
| BORGWARNER INC               | 15.5             | 85                 | 9,527              | 一般消費財・サービス |
| BEST BUY CO INC              | 17               | 100                | 11,206             | 一般消費財・サービス |
| BALL CORP                    | 18.92            | 74                 | 8,386              | 素材         |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 87.5             | 227                | 25,442             | ヘルスケア      |
| BED BATH & BEYOND INC        | 9.5              | 21                 | 2,454              | 一般消費財・サービス |
| XL GROUP LTD                 | 18.5             | 73                 | 8,196              | 金融         |
| ELECTRONIC ARTS INC          | 19               | 200                | 22,458             | 情報技術       |
| VULCAN MATERIALS CO          | 7.5              | 93                 | 10,492             | 素材         |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 15.2             | 218                | 24,482             | ヘルスケア      |
| VF CORP                      | 21               | 155                | 17,443             | 一般消費財・サービス |
| CBS CORP-CLASS B NON VOTING  | 22               | 124                | 13,937             | 一般消費財・サービス |
| VIACOM INC-CLASS B           | 20               | 56                 | 6,368              | 一般消費財・サービス |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 3.5              | 97                 | 10,945             | 一般消費財・サービス |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC    | 21               | 34                 | 3,851              | 情報技術       |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC   | 6                | 66                 | 7,477              | ヘルスケア      |
| CARNIVAL CORP                | 24.5             | 160                | 18,036             | 一般消費財・サービス |
| COMCAST CORP-CLASS A         | 296              | 1,100              | 123,347            | 一般消費財・サービス |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD  | 11               | 46                 | 5,254              | 資本財・サービス   |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 15               | 97                 | 10,889             | 資本財・サービス   |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 60               | 43                 | 4,860              | 不動産        |
| アメリカ・ドル<br>通 貨 計             | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 19,375.08<br>599銘柄 | 145,273<br><60.2%> |            |
| (カナダ)                        | 百株               | 千カナダ・ドル            | 千円                 |            |
| IMPERIAL OIL LTD             | 23               | 90                 | 7,921              | エネルギー      |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 1.5              | 113                | 9,865              | 情報技術       |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD       | 9.38             | 30                 | 2,644              | エネルギー      |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 14.21            | 117                | 10,255             | 一般消費財・サービス |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 22               | 58                 | 5,089              | 素材         |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 10               | 108                | 9,448              | 金融         |

| 銘柄                           | 株数     | 2017年11月30日現在 |        | 業種等        |
|------------------------------|--------|---------------|--------|------------|
|                              |        | 評価額           | 価額     |            |
|                              |        | 外貨建金額         | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株     | 千カナダ・ドル       | 千円     |            |
| BCE INC                      | 9      | 55            | 4,835  | 電気通信サービス   |
| FRANCO-NEVADA CORP           | 11     | 117           | 10,218 | 素材         |
| SUNCOR ENERGY INC            | 107.12 | 475           | 41,407 | エネルギー      |
| METRO INC                    | 16     | 64            | 5,618  | 生活必需品      |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 23     | 146           | 12,777 | 金融         |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 75     | 612           | 53,370 | 金融         |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 29     | 332           | 28,997 | 金融         |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 119    | 893           | 77,788 | 金融         |
| GREAT-WEST LIFECO INC        | 17     | 60            | 5,252  | 金融         |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 92     | 932           | 81,237 | 金融         |
| TOURMALINE OIL CORP          | 13     | 29            | 2,582  | エネルギー      |
| VERMILION ENERGY INC         | 4      | 17            | 1,551  | エネルギー      |
| TRANSCANADA CORP             | 57     | 353           | 30,751 | エネルギー      |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 37.71  | 164           | 14,333 | エネルギー      |
| BOMBARDIER INC-B             | 192    | 56            | 4,933  | 資本財・サービス   |
| BARRICK GOLD CORP            | 83     | 149           | 13,048 | 素材         |
| CAE INC                      | 23     | 51            | 4,517  | 資本財・サービス   |
| THOMSON REUTERS CORP         | 20.2   | 115           | 10,028 | 金融         |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN  | 58     | 145           | 12,669 | 素材         |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 18     | 44            | 3,888  | 生活必需品      |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 6      | 47            | 4,129  | 素材         |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 10     | 59            | 5,217  | 素材         |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | 19     | 18            | 1,608  | 金融         |
| LINAMAR CORP                 | 6      | 40            | 3,557  | 一般消費財・サービス |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | 11     | 18            | 1,644  | エネルギー      |
| HYDRO ONE LTD                | 15     | 34            | 2,964  | 公益事業       |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 14.89  | 101           | 8,842  | 生活必需品      |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 10     | 38            | 3,362  | 公益事業       |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 22     | 148           | 12,915 | 電気通信サービス   |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       | 18     | 100           | 8,787  | 素材         |
| KINROSS GOLD CORP            | 105.34 | 56            | 4,936  | 素材         |
| BANK OF MONTREAL             | 41     | 407           | 35,511 | 金融         |
| POWER CORP OF CANADA         | 31     | 101           | 8,864  | 金融         |
| METHANEX CORP                | 6      | 40            | 3,500  | 素材         |
| SHOPIFY INC - CLASS A        | 5      | 66            | 5,809  | 情報技術       |
| CAMECO CORP                  | 28     | 32            | 2,865  | エネルギー      |
| TELUS CORP                   | 3      | 14            | 1,255  | 電気通信サービス   |
| POWER FINANCIAL CORP         | 20     | 71            | 6,187  | 金融         |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 44     | 128           | 11,163 | 素材         |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 5      | 81            | 7,094  | 一般消費財・サービス |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 80     | 30            | 2,647  | 素材         |
| AGRIUM INC                   | 9      | 125           | 10,945 | 素材         |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 70     | 299           | 26,089 | エネルギー      |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 2      | 139           | 12,154 | 金融         |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 24     | 170           | 14,829 | 一般消費財・サービス |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 2      | 21            | 1,905  | 生活必需品      |
| BLACKBERRY LTD               | 27     | 36            | 3,221  | 情報技術       |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 42     | 213           | 18,616 | 金融         |
| ENBRIDGE INC                 | 105    | 480           | 41,840 | エネルギー      |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 55     | 292           | 25,475 | 金融         |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 125    | 338           | 29,494 | 金融         |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTE | 20     | 42            | 3,698  | ヘルスケア      |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘 柄                          | 2017年11月30日現在    |                  |                   | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|------------------|-------------------|------------|
|                              | 株 数              | 評 価 額            |                   |            |
|                              |                  | 外貨建金額            | 邦貨換算金額            |            |
|                              | 百株               | 千カナダ・ドル          | 千円                |            |
| GOLDCORP INC                 | 63               | 102              | 8,922             | 素材         |
| ENCANA CORP                  | 69               | 102              | 8,912             | エネルギー      |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 10               | 222              | 19,405            | 資本財・サービス   |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 11               | 65               | 5,666             | 金融         |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 14               | 57               | 4,977             | 一般消費財・サービス |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 48               | 471              | 41,055            | 資本財・サービス   |
| CGI GROUP INC - CLASS A      | 13               | 88               | 7,700             | 情報技術       |
| HUSKY ENERGY INC             | 30.12            | 45               | 4,006             | エネルギー      |
| ONEX CORPORATION             | 7                | 64               | 5,601             | 金融         |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    | 22               | 63               | 5,560             | 一般消費財・サービス |
| FINNING INTERNATIONAL INC    | 7                | 21               | 1,850             | 資本財・サービス   |
| SNC-LAVALIN GROUP INC        | 9                | 49               | 4,347             | 資本財・サービス   |
| IGM FINANCIAL INC            | 3                | 13               | 1,166             | 金融         |
| OPEN TEXT CORP               | 14               | 58               | 5,119             | 情報技術       |
| CI FINANCIAL CORP            | 20               | 57               | 4,983             | 金融         |
| SAPUTO INC                   | 13               | 56               | 4,958             | 生活必需品      |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 33               | 47               | 4,170             | 素材         |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B   | 25               | 163              | 14,280            | 生活必需品      |
| YAMANA GOLD INC              | 52               | 17               | 1,539             | 素材         |
| FORTIS INC                   | 30               | 142              | 12,393            | 公益事業       |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP   | 25               | 22               | 1,990             | エネルギー      |
| CENOVUS ENERGY INC           | 80               | 94               | 8,236             | エネルギー      |
| DOLLARAMA INC                | 6                | 96               | 8,419             | 一般消費財・サービス |
| ATCO LTD -CLASS I            | 8                | 36               | 3,180             | 公益事業       |
| ALTAGAS LTD                  | 8                | 23               | 2,022             | エネルギー      |
| FIRST CAPITAL REALTY INC     | 20               | 41               | 3,630             | 不動産        |
| KEYERA CORP                  | 7                | 25               | 2,180             | エネルギー      |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP | 7                | 10               | 941               | エネルギー      |
| INTER PIPELINE LTD           | 20               | 53               | 4,687             | エネルギー      |
| ARC RESOURCES LTD            | 28               | 44               | 3,877             | エネルギー      |
| カナダ・ドル<br>通 貨 計              | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 2,767.47<br>88銘柄 | 11,503<br>< 3.7%> | 1,001,957  |
| -----                        |                  |                  |                   |            |
| (オーストラリア)                    | 百株               | 千オーストラリア・ドル      | 千円                |            |
| HEALTHSCOPE LTD              | 160              | 31               | 2,668             | ヘルスケア      |
| MEDIBANK PRIVATE LTD         | 228.24           | 73               | 6,256             | 金融         |
| BHP BILLITON LIMITED         | 206.58           | 570              | 48,459            | 素材         |
| SOUTH32 LTD                  | 362.13           | 121              | 10,295            | 素材         |
| ALUMINA LTD                  | 121              | 27               | 2,372             | 素材         |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD       | 57.74            | 179              | 15,264            | エネルギー      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD   | 105              | 48               | 4,117             | 素材         |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK    | 36               | 41               | 3,495             | 金融         |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  | 172.43           | 510              | 43,287            | 金融         |
| WESTPAC BANKING CORP         | 214.5            | 675              | 57,308            | 金融         |
| SANTOS LTD                   | 96               | 49               | 4,195             | エネルギー      |
| AUST AND NZ BANKING GROUP    | 190.88           | 549              | 46,607            | 金融         |
| RIO TINTO LTD                | 24.5             | 175              | 14,908            | 素材         |
| ORIGIN ENERGY LTD            | 120.5            | 108              | 9,245             | エネルギー      |
| AMCOR LIMITED                | 74.96            | 116              | 9,899             | 素材         |
| AURIZON HOLDINGS LTD         | 153.1            | 79               | 6,756             | 資本財・サービス   |
| OIL SEARCH LTD               | 84               | 59               | 5,040             | エネルギー      |
| SEEK LTD                     | 26               | 48               | 4,126             | 資本財・サービス   |
| TREASURY WINE ESTATES LTD    | 55.92            | 86               | 7,356             | 生活必需品      |

| 銘 柄                          | 2017年11月30日現在    |                 |                  | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|-----------------|------------------|------------|
|                              | 株 数              | 評 価 額           |                  |            |
|                              |                  | 外貨建金額           | 邦貨換算金額           |            |
|                              | 百株               | 千円              |                  |            |
| NEWCREST MINING LTD          | 58.04            | 139             | 11,851           | 素材         |
| INCITEC PIVOT LTD            | 73               | 29              | 2,465            | 素材         |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 111.77           | 905             | 76,816           | 金融         |
| CALTEX AUSTRALIA LTD         | 20               | 68              | 5,781            | エネルギー      |
| ORICA LTD                    | 20               | 34              | 2,919            | 素材         |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      | 88               | 93              | 7,968            | 金融         |
| CIMIC GROUP LTD              | 10               | 52              | 4,420            | 資本財・サービス   |
| WOOLWORTHS LTD               | 76.65            | 206             | 17,538           | 生活必需品      |
| COCA-COLA AMATIL LTD         | 26               | 20              | 1,712            | 生活必需品      |
| TABCORP HOLDINGS LTD         | 24               | 11              | 987              | 一般消費財・サービス |
| CROWN RESORTS LTD            | 30               | 37              | 3,187            | 一般消費財・サービス |
| TELSTRA CORP LTD             | 206.8            | 70              | 5,949            | 電気通信サービス   |
| AMP LTD                      | 165.13           | 85              | 7,259            | 金融         |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  | 32               | 69              | 5,858            | 素材         |
| MACQUARIE GROUP LTD          | 21.13            | 210             | 17,891           | 金融         |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 40.35            | 95              | 8,081            | 一般消費財・サービス |
| BANK OF QUEENSLAND LTD       | 30               | 39              | 3,317            | 金融         |
| CSL LTD                      | 31.02            | 452             | 38,429           | ヘルスケア      |
| WESFARMERS LTD               | 69.85            | 305             | 25,888           | 生活必需品      |
| COCHLEAR LTD                 | 4.44             | 81              | 6,922            | ヘルスケア      |
| BLUESCOPE STEEL LTD          | 32.12            | 44              | 3,797            | 素材         |
| SUNCORP GROUP LTD            | 99.38            | 141             | 12,044           | 金融         |
| BORAL LTD                    | 86               | 65              | 5,539            | 素材         |
| ASX LTD                      | 13               | 74              | 6,325            | 金融         |
| COMPUTERSHARE LTD            | 37               | 61              | 5,193            | 情報技術       |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 175.18           | 126             | 10,749           | 金融         |
| SONIC HEALTHCARE LTD         | 25               | 55              | 4,742            | ヘルスケア      |
| CHALLENGER LTD               | 25               | 35              | 2,970            | 金融         |
| TATTS GROUP LTD              | 80               | 34              | 2,946            | 一般消費財・サービス |
| AGL ENERGY LTD               | 40.5             | 102             | 8,706            | 公益事業       |
| BRAMBLES LTD                 | 113.37           | 116             | 9,862            | 資本財・サービス   |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       | 9                | 62              | 5,323            | ヘルスケア      |
| REA GROUP LTD                | 6.08             | 48              | 4,134            | 情報技術       |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 6.21             | 29              | 2,471            | 一般消費財・サービス |
| オーストラリア・ドル<br>通 貨 計          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 4,375.5<br>53銘柄 | 7,561<br>< 2.4%> | 641,718    |
| (香港)                         | 百株               | 千香港ドル           | 千円               |            |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 90               | 603             | 8,653            | 公益事業       |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 170              | 985             | 14,136           | 一般消費財・サービス |
| MTR CORP                     | 75               | 344             | 4,945            | 資本財・サービス   |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 90               | 1,153           | 16,557           | 不動産        |
| SINO LAND CO                 | 120              | 166             | 2,386            | 不動産        |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 195.52           | 1,903           | 27,313           | 資本財・サービス   |
| WHARF HOLDINGS LTD           | 80               | 196             | 2,818            | 不動産        |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 35               | 263             | 3,781            | 不動産        |
| CLP HOLDINGS LTD             | 100              | 812             | 11,652           | 公益事業       |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 95.59            | 493             | 7,084            | 不動産        |
| HANG LUNG GROUP LTD          | 80               | 216             | 3,099            | 不動産        |
| HONG KONG & CHINA GAS        | 510.96           | 780             | 11,203           | 公益事業       |
| HANG SENG BANK LTD           | 47               | 892             | 12,807           | 金融         |
| WHEELOCK & CO LTD            | 60               | 319             | 4,589            | 不動産        |
| NEW WORLD DEVELOPMENT        | 320              | 360             | 5,170            | 不動産        |



| 銘柄                            | 2017年11月30日現在    |              |                    | 業 種 等      |
|-------------------------------|------------------|--------------|--------------------|------------|
|                               | 株 数              | 評 価 額        | 外貨建金額 邦貨換算金額       |            |
| WH GROUP LTD                  | 百株 585           | 千香港ドル 488    | 千円 7,009           | 生活必需品      |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR   | 80               | 1,920        | 27,552             | 金融         |
| LI & FUNG LTD                 | 700              | 242          | 3,475              | 一般消費財・サービス |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD      | 120              | 220          | 3,158              | 不動産        |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY        | 20               | 233          | 3,346              | 情報技術       |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG      | 80               | 224          | 3,220              | 一般消費財・サービス |
| NWS HOLDINGS LTD              | 150              | 207          | 2,979              | 資本財・サービス   |
| KERRY PROPERTIES LTD          | 75               | 258          | 3,713              | 不動産        |
| BANK OF EAST ASIA LTD         | 86               | 288          | 4,140              | 金融         |
| HYSAN DEVELOPMENT CO          | 60               | 240          | 3,444              | 不動産        |
| SJM HOLDINGS LTD              | 100              | 63           | 909                | 一般消費財・サービス |
| SWIRE PROPERTIES LTD          | 80               | 210          | 3,013              | 不動産        |
| CK ASSET HOLDINGS LTD         | 185.52           | 1,212        | 17,397             | 不動産        |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L  | 55               | 369          | 5,299              | 公益事業       |
| PCCW LTD                      | 600              | 276          | 3,969              | 電気通信サービス   |
| AIA GROUP LTD                 | 778              | 5,130        | 73,628             | 金融         |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT  | 80               | 381          | 5,470              | 不動産        |
| SANDS CHINA LTD               | 166              | 637          | 9,147              | 一般消費財・サービス |
| SHANGRI-LA ASIA LTD           | 40               | 72           | 1,036              | 一般消費財・サービス |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD  | 120              | 540          | 7,749              | 一般消費財・サービス |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD    | 215              | 836          | 12,001             | 金融         |
| WYNN MACAU LTD                | 60               | 140          | 2,019              | 一般消費財・サービス |
| 香港ドル株数、金額<br>通貨計 銘柄数<比率>      | 6,504.59<br>37銘柄 | 23,685       | 339,881<br>< 1.3%> |            |
| (シンガポール)                      | 百株               | 千シンガポール・ドル   | 千円                 |            |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD      | 90               | 234          | 19,481             | 金融         |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD        | 108              | 266          | 22,155             | 金融         |
| SINGAPORE AIRLINES LTD        | 20               | 21           | 1,755              | 資本財・サービス   |
| KEPPEL CORP LTD               | 93               | 71           | 5,964              | 資本財・サービス   |
| UOL GROUP LTD                 | 52               | 45           | 3,802              | 不動産        |
| CITY DEVELOPMENTS LTD         | 10               | 12           | 1,000              | 不動産        |
| CAPITALAND LTD                | 190              | 66           | 5,563              | 不動産        |
| YANGJUIANG SHIPBUILDING       | 270              | 41           | 3,436              | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD  | 120              | 32           | 2,725              | 一般消費財・サービス |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD  | 9                | 35           | 2,991              | 一般消費財・サービス |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP  | 218              | 268          | 22,306             | 金融         |
| GENTING SINGAPORE PLC         | 450              | 61           | 5,091              | 一般消費財・サービス |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS  | 484              | 181          | 15,058             | 電気通信サービス   |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING    | 141              | 45           | 3,812              | 資本財・サービス   |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD       | 40               | 12           | 1,018              | 資本財・サービス   |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD     | 90               | 3            | 284                | 生活必需品      |
| SATS LTD                      | 77               | 40           | 3,330              | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD        | 69               | 51           | 4,287              | 金融         |
| COMFORTDELGRO CORP LTD        | 100              | 20           | 1,697              | 資本財・サービス   |
| STARHUB LTD                   | 120              | 34           | 2,875              | 電気通信サービス   |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD      | 158              | 49           | 4,153              | 生活必需品      |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L  | 190              | 63           | 5,279              | 不動産        |
| シンガポール・ドル株数、金額<br>通貨計 銘柄数<比率> | 3,099<br>22銘柄    | 1,659        | 138,073<br>< 0.5%> |            |
| (ニュージーランド)                    | 百株               | 千ニュージーランド・ドル | 千円                 |            |
| MERIDIAN ENERGY LTD           | 150              | 42           | 3,278              | 公益事業       |

| 銘柄                              | 2017年11月30日現在 |       |                   | 業 種 等      |
|---------------------------------|---------------|-------|-------------------|------------|
|                                 | 株 数           | 評 価 額 | 外貨建金額 邦貨換算金額      |            |
| SPARK NEW ZEALAND LTD           | 百株 168.6      | 千円 60 | 4,641             | 電気通信サービス   |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD       | 81            | 52    | 4,049             | 資本財・サービス   |
| FLETCHER BUILDING LTD           | 19            | 13    | 997               | 素材         |
| RYMAN HEALTHCARE LTD            | 44.19         | 45    | 3,524             | ヘルスケア      |
| ニュージーランド・ドル株数、金額<br>通貨計 銘柄数<比率> | 462.79<br>5銘柄 | 215   | 16,490<br>< 0.1%> |            |
| (イギリス)                          | 百株            | 千円    |                   |            |
| MERLIN ENTERTAINMENT            | 50            | 17    | 2,675             | 一般消費財・サービス |
| TUI AG-DI                       | 26            | 34    | 5,260             | 一般消費財・サービス |
| BP PLC                          | 1,272.11      | 629   | 94,566            | エネルギー      |
| UNILEVER PLC                    | 80.24         | 338   | 50,855            | 生活必需品      |
| BARCLAYS PLC                    | 1,054.37      | 204   | 30,789            | 金融         |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC        | 107.7         | 92    | 13,940            | 資本財・サービス   |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC       | 105           | 32    | 4,931             | 一般消費財・サービス |
| RANDGOLD RESOURCES LTD          | 5             | 34    | 5,197             | 素材         |
| PRUDENTIAL PLC                  | 172.78        | 328   | 49,350            | 金融         |
| INMARSAT PLC                    | 42.34         | 20    | 3,080             | 電気通信サービス   |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP    | 236.79        | 66    | 10,024            | 金融         |
| JOHNSON MATTHEY PLC             | 10.3          | 31    | 4,736             | 素材         |
| BAE SYSTEMS PLC                 | 190.5         | 103   | 15,578            | 資本財・サービス   |
| AVIVA PLC                       | 273.06        | 138   | 20,893            | 金融         |
| GLAXOSMITHKLINE PLC             | 323           | 422   | 63,487            | ヘルスケア      |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL       | 31.33         | 78    | 11,765            | 情報技術       |
| WORLDPAY GROUP PLC              | 135.17        | 56    | 8,493             | 情報技術       |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC    | 29            | 15    | 2,354             | ヘルスケア      |
| AUTO TRADER GROUP PLC           | 42            | 14    | 2,130             | 情報技術       |
| DCC PLC                         | 5             | 36    | 5,441             | 資本財・サービス   |
| CONVATEC GROUP PLC              | 65.81         | 12    | 1,890             | ヘルスケア      |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS- ENTITL    | 4,954.2       | 0     | 74                | その他        |
| ROYAL MAIL PLC                  | 32.5          | 14    | 2,134             | 資本財・サービス   |
| RELX PLC                        | 66            | 115   | 17,363            | 資本財・サービス   |
| DIAGEO PLC                      | 159.54        | 413   | 62,201            | 生活必需品      |
| RIO TINTO PLC                   | 80.59         | 283   | 42,620            | 素材         |
| STANDARD CHARTERED PLC          | 220.5         | 165   | 24,827            | 金融         |
| TESCO PLC                       | 591.54        | 117   | 17,607            | 生活必需品      |
| FRESNILLO PLC                   | 24            | 31    | 4,701             | 素材         |
| SMITH & NEPHEW PLC              | 59.67         | 78    | 11,759            | ヘルスケア      |
| GLENCORE PLC                    | 805.44        | 275   | 41,470            | 素材         |
| WOOD GROUP (JOHN) PLC           | 54.66         | 38    | 5,858             | エネルギー      |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC         | 15            | 23    | 3,603             | 金融         |
| SMITHS GROUP PLC                | 22.6          | 33    | 5,089             | 資本財・サービス   |
| BABCOCK INTL GROUP PLC          | 6             | 4     | 630               | 資本財・サービス   |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP     | 109.63        | 39    | 6,002             | 金融         |
| DIXONS CARPHONE PLC             | 47            | 7     | 1,162             | 一般消費財・サービス |
| PEARSON PLC                     | 43            | 30    | 4,576             | 一般消費財・サービス |
| SAINSBURY (J) PLC               | 68.5          | 16    | 2,426             | 生活必需品      |
| NEXT PLC                        | 11.59         | 52    | 7,845             | 一般消費財・サービス |
| TAYLOR WIMPEY PLC               | 170           | 33    | 5,014             | 一般消費財・サービス |
| WHITBREAD PLC                   | 9.5           | 34    | 5,189             | 一般消費財・サービス |
| IMI PLC                         | 24.1          | 30    | 4,619             | 資本財・サービス   |
| BUNZL PLC                       | 19            | 40    | 6,021             | 資本財・サービス   |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 株数       | 2017年11月30日現在 |         | 業種等        |
|------------------------------|----------|---------------|---------|------------|
|                              |          | 評価額           | 価額      |            |
|                              |          | 外貨建金額         | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株       | 千円            | 千円      |            |
| GKN PLC                      | 92       | 28            | 4,305   | 一般消費財・サービス |
| VODAFONE GROUP PLC           | 1,691.14 | 380           | 57,265  | 電気通信サービス   |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      | 8.03     | 34            | 5,185   | 素材         |
| KINGFISHER PLC               | 172.29   | 57            | 8,715   | 一般消費財・サービス |
| WPP PLC                      | 77       | 100           | 15,163  | 一般消費財・サービス |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 36.9     | 29            | 4,493   | 公益事業       |
| SEVERN TRENT PLC             | 13       | 27            | 4,160   | 公益事業       |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 43.64    | 284           | 42,760  | 生活必需品      |
| ST JAMES'S PLACE PLC         | 27       | 32            | 4,919   | 金融         |
| SCHRODERS PLC                | 5.5      | 19            | 2,856   | 金融         |
| TATE & LYLE PLC              | 20       | 13            | 2,008   | 生活必需品      |
| SSE PLC                      | 61.06    | 83            | 12,502  | 公益事業       |
| WEIR GROUP PLC/THE           | 13       | 26            | 3,916   | 資本財・サービス   |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 59       | 35            | 5,401   | 一般消費財・サービス |
| ASTRAZENECA PLC              | 80.08    | 392           | 58,988  | ヘルスケア      |
| FERGUSON PLC                 | 16       | 85            | 12,880  | 資本財・サービス   |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 399.29   | 107           | 16,110  | 金融         |
| 3I GROUP PLC                 | 57.37    | 52            | 7,895   | 金融         |
| SKY PLC                      | 63       | 58            | 8,855   | 一般消費財・サービス |
| ASHTREAD GROUP PLC           | 39       | 75            | 11,309  | 資本財・サービス   |
| SAGE GROUP PLC/THE           | 58.79    | 45            | 6,884   | 情報技術       |
| NATIONAL GRID PLC            | 228.11   | 200           | 30,176  | 公益事業       |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 4,676.86 | 313           | 47,176  | 金融         |
| RSA INSURANCE GROUP PLC      | 63.8     | 38            | 5,826   | 金融         |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 61.07    | 186           | 27,964  | 生活必需品      |
| CENTRICA PLC                 | 380.02   | 54            | 8,157   | 公益事業       |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | 7        | 26            | 4,042   | 一般消費財・サービス |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC      | 5.5      | 4             | 731     | 金融         |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 150.57   | 723           | 108,694 | 生活必需品      |
| BHP BILLITON PLC             | 135.12   | 182           | 27,421  | 素材         |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 19.5     | 58            | 8,829   | 生活必需品      |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 1,318.5  | 979           | 147,309 | 金融         |
| SHIRE PLC                    | 56.38    | 209           | 31,499  | ヘルスケア      |
| OLD MUTUAL PLC               | 307.12   | 61            | 9,256   | 金融         |
| ANGLO AMERICAN PLC           | 91.68    | 126           | 18,964  | 素材         |
| MONDI PLC                    | 34       | 60            | 9,041   | 素材         |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     | 145      | 31            | 4,760   | 生活必需品      |
| CARNIVAL PLC                 | 13.83    | 67            | 10,102  | 一般消費財・サービス |
| EASYJET PLC                  | 16.44    | 23            | 3,477   | 資本財・サービス   |
| COMPASS GROUP PLC            | 105.61   | 159           | 24,052  | 一般消費財・サービス |
| PERSIMMON PLC                | 25.69    | 66            | 10,006  | 一般消費財・サービス |
| BT GROUP PLC                 | 557.73   | 142           | 21,413  | 電気通信サービス   |
| COCA-COLA HBC AG-DI          | 12       | 28            | 4,306   | 生活必需品      |
| BURBERRY GROUP PLC           | 33       | 56            | 8,552   | 一般消費財・サービス |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 13.72    | 60            | 9,027   | 一般消費財・サービス |
| CAPITA PLC                   | 49       | 24            | 3,644   | 資本財・サービス   |
| TRAVIS PERKINS PLC           | 17       | 26            | 4,053   | 資本財・サービス   |
| INTERTEK GROUP PLC           | 10       | 52            | 7,854   | 資本財・サービス   |
| ITV PLC                      | 275.87   | 43            | 6,569   | 一般消費財・サービス |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 20.35    | 77            | 11,640  | 金融         |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  | 284.55   | 673           | 101,208 | エネルギー      |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  | 242.47   | 585           | 88,027  | エネルギー      |

| 銘柄                           | 株数               | 2017年11月30日現在      |                   | 業種等        |
|------------------------------|------------------|--------------------|-------------------|------------|
|                              |                  | 評価額                | 価額                |            |
|                              |                  | 外貨建金額              | 邦貨換算金額            |            |
|                              | 百株               | 千円                 | 千円                |            |
| MEGGITT PLC                  | 35               | 17                 | 2,563             | 資本財・サービス   |
| G4S PLC                      | 113.2            | 29                 | 4,364             | 資本財・サービス   |
| COBHAM PLC                   | 196.77           | 25                 | 3,809             | 資本財・サービス   |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    | 10               | 10                 | 1,545             | ヘルスケア      |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 15.7             | 30                 | 4,533             | 金融         |
| INVESTEC PLC                 | 46               | 23                 | 3,578             | 金融         |
| ANTOFAGASTA PLC              | 34.6             | 31                 | 4,790             | 素材         |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC   | 204.57           | 87                 | 13,106            | 金融         |
| EXPERIAN PLC                 | 56.18            | 87                 | 13,158            | 資本財・サービス   |
| イギリス・ポンド<br>通貨計              | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 24,954.66<br>105銘柄 | 12,253<br>< 6.8%> | 1,842,068  |
| (イスラエル)                      | 百株               | 千円                 | 千円                |            |
| AZRIELI GROUP LTD            | 5.3              | 98                 | 3,164             | 不動産        |
| FRUTAROM                     | 4.18             | 125                | 4,022             | 素材         |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 50               | 25                 | 819               | 電気通信サービス   |
| ELBIT SYSTEMS LTD            | 3                | 148                | 4,734             | 資本財・サービス   |
| BANK HAPOLIM BM              | 79               | 188                | 6,038             | 金融         |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 114              | 223                | 7,145             | 金融         |
| NICE LTD                     | 2                | 61                 | 1,952             | 情報技術       |
| イスラエル・シェケル<br>通貨計            | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 257.48<br>7銘柄      | 871<br>< 0.1%>    | 27,876     |
| (スイス)                        | 百株               | 千円                 | 千円                |            |
| DUFREY AG-REG                | 1.89             | 26                 | 3,050             | 一般消費財・サービス |
| UBS GROUP AG-REG             | 236.61           | 402                | 45,813            | 金融         |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 0.5              | 32                 | 3,682             | 素材         |
| ADECCO GROUP AG-REG          | 10.87            | 80                 | 9,174             | 資本財・サービス   |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 44.7             | 1,107              | 126,085           | ヘルスケア      |
| PARGESA HOLDING SA-BR        | 3.89             | 32                 | 3,706             | 金融         |
| SIKA AG-BR                   | 0.14             | 106                | 12,071            | 素材         |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  | 0.01             | 67                 | 7,709             | 生活必需品      |
| ABB LTD-REG                  | 131.26           | 329                | 37,532            | 資本財・サービス   |
| SWISS RE AG                  | 20.5             | 190                | 21,666            | 金融         |
| NESTLE SA-REG                | 199              | 1,690              | 192,430           | 生活必需品      |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 1.05             | 70                 | 8,007             | 金融         |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 3                | 66                 | 7,598             | 資本財・サービス   |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 161.81           | 264                | 30,096            | 金融         |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 15.65            | 89                 | 10,172            | 金融         |
| SGS SA-REG                   | 0.32             | 76                 | 8,749             | 資本財・サービス   |
| VIFOR PHARMA AG              | 3.69             | 45                 | 5,204             | ヘルスケア      |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 1.8              | 64                 | 7,337             | 一般消費財・サービス |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 9.37             | 276                | 31,528            | 金融         |
| BALOISE HOLDING AG - REG     | 3.2              | 48                 | 5,503             | 金融         |
| NOVARTIS AG-REG              | 142.95           | 1,196              | 136,196           | ヘルスケア      |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 0.2              | 36                 | 4,106             | 生活必需品      |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 34.68            | 292                | 33,238            | 一般消費財・サービス |
| SWISSCOM AG-REG              | 1.8              | 92                 | 10,562            | 電気通信サービス   |
| GEBERIT AG-REG               | 2.34             | 99                 | 11,360            | 資本財・サービス   |
| GIVAUDAN-REG                 | 0.68             | 150                | 17,145            | 素材         |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 0.52             | 37                 | 4,306             | ヘルスケア      |
| SONOVA HOLDING AG-REG        | 3                | 46                 | 5,269             | ヘルスケア      |
| LONZA GROUP AG-REG           | 5.42             | 137                | 15,707            | ヘルスケア      |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG      | 4.5              | 31                 | 3,549             | 一般消費財・サービス |



| 銘柄                           | 株数                           | 2017年11月30日現在  |                    | 業種等        |
|------------------------------|------------------------------|----------------|--------------------|------------|
|                              |                              | 評価額            | 価額                 |            |
| 株数                           | 外貨建金額                        | 邦貨換算金額         |                    |            |
| 百株                           | 千円                           |                |                    |            |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG        | 31.17                        | 168            | 19,159             | 素材         |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 2.31                         | 76             | 8,672              | 金融         |
| KUEHN + NAGEL INTL AG-REG    | 3                            | 51             | 5,842              | 資本財・サービス   |
| SWISS PRIME SITE-REG         | 4.5                          | 38             | 4,341              | 不動産        |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | 0.03                         | 17             | 1,949              | 生活必需品      |
| スイス・フラン<br>通 貨 計             | 1,086.36<br>株数、金額<br>銘柄数<比率> | 7,542<br>35銘柄  | 858,530<br>< 3.2%> |            |
| (デンマーク)                      |                              |                |                    |            |
| 百株                           | 千円                           |                |                    |            |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 123.55                       | 3,978          | 70,973             | ヘルスケア      |
| DANSKE BANK A/S              | 47.44                        | 1,127          | 20,117             | 金融         |
| ISS A/S                      | 13.2                         | 307            | 5,489              | 資本財・サービス   |
| AP MOELLER-MAERSK A/S-A      | 0.3                          | 314            | 5,608              | 資本財・サービス   |
| H LUNDBECK A/S               | 5                            | 154            | 2,761              | ヘルスケア      |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 13.38                        | 524            | 9,354              | 資本財・サービス   |
| TDC A/S                      | 68                           | 255            | 4,566              | 電気通信サービス   |
| CARLSBERG AS-B               | 8.06                         | 590            | 10,539             | 生活必需品      |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES       | 11.05                        | 367            | 6,560              | 素材         |
| COLOPLAST-B                  | 6.5                          | 319            | 5,693              | ヘルスケア      |
| DSV A/S                      | 12                           | 573            | 10,233             | 資本財・サービス   |
| WILLIAM DEMANT HOLDING       | 13.14                        | 227            | 4,053              | ヘルスケア      |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       | 0.43                         | 468            | 8,361              | 資本財・サービス   |
| PANDORA A/S                  | 7.5                          | 456            | 8,135              | 一般消費財・サービス |
| CHR HANSEN HOLDING A/S       | 7.5                          | 414            | 7,385              | 素材         |
| GENMAB A/S                   | 4.33                         | 519            | 9,269              | ヘルスケア      |
| ORSTED A/S                   | 8.71                         | 309            | 5,527              | 公益事業       |
| デンマーク・クローネ<br>通 貨 計          | 350.09<br>株数、金額<br>銘柄数<比率>   | 10,909<br>17銘柄 | 194,630<br>< 0.7%> |            |
| (ノルウェー)                      |                              |                |                    |            |
| 百株                           | 千円                           |                |                    |            |
| NORSK HYDRO ASA              | 74.5                         | 441            | 5,989              | 素材         |
| DNB ASA                      | 62.45                        | 946            | 12,856             | 金融         |
| ORKLA ASA                    | 70                           | 581            | 7,889              | 生活必需品      |
| TELENOR ASA                  | 46                           | 846            | 11,494             | 電気通信サービス   |
| STATOIL ASA                  | 76.17                        | 1,268          | 17,222             | エネルギー      |
| YARA INTERNATIONAL ASA       | 8.5                          | 316            | 4,300              | 素材         |
| MARINE HARVEST               | 23.5                         | 332            | 4,522              | 生活必需品      |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    | 20                           | 304            | 4,136              | 金融         |
| SCHIBSTED ASA-B SHS          | 17                           | 356            | 4,836              | 一般消費財・サービス |
| ノルウェー・クローネ<br>通 貨 計          | 398.12<br>株数、金額<br>銘柄数<比率>   | 5,393<br>9銘柄   | 73,248<br>< 0.3%>  |            |
| (スウェーデン)                     |                              |                |                    |            |
| 百株                           | 千円                           |                |                    |            |
| ICA GRUPPEN AB               | 7                            | 211            | 2,824              | 生活必需品      |
| ERICSSON LM-B SHS            | 207                          | 1,101          | 14,734             | 情報技術       |
| VOLVO AB-B SHS               | 101.88                       | 1,612          | 21,578             | 資本財・サービス   |
| MILICOM INTL CELLULAR-SDR    | 2                            | 107            | 1,434              | 電気通信サービス   |
| SKF AB-B SHARES              | 21                           | 405            | 5,425              | 資本財・サービス   |
| ELECTROLUX AB-SER B          | 15                           | 410            | 5,491              | 一般消費財・サービス |
| NORDEA BANK AB               | 196.49                       | 1,927          | 25,790             | 金融         |
| SWEDISH MATCH AB             | 12                           | 377            | 5,054              | 生活必需品      |
| TELE2 AB-B SHS               | 32.58                        | 349            | 4,673              | 電気通信サービス   |
| GETINGE AB-B SHS             | 19                           | 289            | 3,879              | ヘルスケア      |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 96                           | 948            | 12,690             | 金融         |

| 銘柄                           | 株数                           | 2017年11月30日現在  |                    | 業種等        |
|------------------------------|------------------------------|----------------|--------------------|------------|
|                              |                              | 評価額            | 価額                 |            |
| 株数                           | 外貨建金額                        | 邦貨換算金額         |                    |            |
| 百株                           | 千円                           |                |                    |            |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 100                          | 1,144          | 15,306             | 金融         |
| SWEDBANK AB - A SHARES       | 55                           | 1,096          | 14,666             | 金融         |
| HENNES + MAURITZ AB-B SHS    | 66.23                        | 1,290          | 17,262             | 一般消費財・サービス |
| SKANSKA AB-B SHS             | 18                           | 328            | 4,390              | 資本財・サービス   |
| SANDVIK AB                   | 81.22                        | 1,180          | 15,800             | 資本財・サービス   |
| INVESTOR AB-B SHS            | 25.84                        | 1,018          | 13,622             | 金融         |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         | 40.41                        | 1,473          | 19,718             | 資本財・サービス   |
| SECURITAS AB-B SHS           | 25                           | 364            | 4,880              | 資本財・サービス   |
| TELIA CO AB                  | 158                          | 579            | 7,758              | 電気通信サービス   |
| ALFA LAVAL AB                | 20                           | 399            | 5,349              | 資本財・サービス   |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         | 25                           | 817            | 10,931             | 資本財・サービス   |
| ASSA ABLOY AB-B              | 67.9                         | 1,163          | 15,562             | 資本財・サービス   |
| LUNDBERGS AB-B SHS           | 4.74                         | 294            | 3,935              | 金融         |
| LUNDIN PETROLEUM AB          | 19                           | 369            | 4,944              | エネルギー      |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B          | 36.5                         | 885            | 11,842             | 生活必需品      |
| BOLIDEN AB                   | 18                           | 483            | 6,471              | 素材         |
| HUSQVARNA AB-B SHS           | 24                           | 184            | 2,464              | 一般消費財・サービス |
| KINNEVIK AB - B              | 15                           | 403            | 5,392              | 金融         |
| HEXAGON AB-B SHS             | 17                           | 698            | 9,348              | 情報技術       |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | 13                           | 265            | 3,551              | 金融         |
| スウェーデン・クローネ<br>通 貨 計         | 1,539.79<br>株数、金額<br>銘柄数<比率> | 22,180<br>31銘柄 | 296,780<br>< 1.1%> |            |
| ユーロ (アイルランド)                 |                              |                |                    |            |
| 百株                           | 千円                           |                |                    |            |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC    | 52.34                        | 34             | 4,573              | 金融         |
| KERRY GROUP PLC-A            | 12.66                        | 110            | 14,730             | 生活必需品      |
| CRH PLC                      | 50.5                         | 150            | 19,939             | 素材         |
| PADDY POWER BETFAIR PLC      | 4.6                          | 44             | 5,847              | 一般消費財・サービス |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率>             | 120.1<br>4銘柄   | 339<br>< 0.2%>     |            |
| ユーロ (オランダ)                   |                              |                |                    |            |
| 百株                           | 千円                           |                |                    |            |
| QIAGEN N.V.                  | 12.99                        | 34             | 4,631              | ヘルスケア      |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 59.5                         | 192            | 25,630             | ヘルスケア      |
| NN GROUP NV                  | 22.5                         | 80             | 10,730             | 金融         |
| UNILEVER NV-CVA              | 106.44                       | 520            | 69,069             | 生活必需品      |
| HEINEKEN NV                  | 14.9                         | 127            | 16,917             | 生活必需品      |
| RELX NV                      | 64                           | 124            | 16,532             | 資本財・サービス   |
| AEGON NV                     | 143.61                       | 75             | 10,030             | 金融         |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 76.26                        | 133            | 17,683             | 生活必需品      |
| AKZO NOBEL                   | 17.25                        | 130            | 17,335             | 素材         |
| KONINKLIJKE DSM NV           | 10.5                         | 82             | 10,952             | 素材         |
| WOLTERS KLUWER               | 23.76                        | 103            | 13,691             | 資本財・サービス   |
| BOSKALIS WESTMINSTER         | 9.1                          | 28             | 3,737              | 資本財・サービス   |
| ING GROEP NV                 | 242.18                       | 371            | 49,371             | 金融         |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 239                          | 72             | 9,687              | 電気通信サービス   |
| ASML HOLDING NV              | 23.06                        | 341            | 45,311             | 情報技術       |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA        | 24                           | 59             | 7,896              | 金融         |
| VOPAK                        | 6.3                          | 22             | 2,935              | エネルギー      |
| RANDSTAD HOLDING NV          | 7.5                          | 38             | 5,103              | 資本財・サービス   |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 6                            | 48             | 6,431              | 生活必需品      |
| GEMALTO                      | 7                            | 22             | 2,945              | 情報技術       |
| ALTICE NV - A                | 33.5                         | 23             | 3,127              | 一般消費財・サービス |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 株数               | 2017年11月30日現在    |                              | 業種等        |
|------------------------------|------------------|------------------|------------------------------|------------|
|                              |                  | 評価額              | 価額                           |            |
|                              |                  | 外貨建金額            | 邦貨換算金額                       |            |
| ALTICE NV - B                | 15               | 10               | 1,404                        | 一般消費財・サービス |
| AIRBUS SE                    | 35.97            | 313              | 41,699                       | 資本財・サービス   |
| EXOR NV                      | 4.5              | 23               | 3,077                        | 金融         |
| CNH INDUSTRIAL NV            | 73.53            | 79               | 10,595                       | 資本財・サービス   |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 70.44            | 101              | 13,527                       | 一般消費財・サービス |
| FERRARI NV                   | 8.3              | 77               | 10,235                       | 一般消費財・サービス |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,357.09<br>27銘柄 | 3,239<br>430,296<br>< 1.6% > |            |
| ユーロ (ベルギー)                   | 株数               | 千ユーロ             | 千円                           |            |
| UCB SA                       | 7                | 45               | 5,997                        | ヘルスケア      |
| KBC GROEP NV                 | 17.34            | 119              | 15,844                       | 金融         |
| COLRUYT SA                   | 3.5              | 15               | 2,052                        | 生活必需品      |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA  | 4                | 35               | 4,770                        | 金融         |
| SOLVAY SA                    | 5.36             | 63               | 8,375                        | 素材         |
| UMICORE                      | 16               | 62               | 8,279                        | 素材         |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   | 49.65            | 485              | 64,522                       | 生活必需品      |
| AGEAS                        | 8.78             | 36               | 4,790                        | 金融         |
| PROXIMUS                     | 7                | 19               | 2,656                        | 電気通信サービス   |
| TELENET GROUP HOLDING NV     | 4.62             | 26               | 3,572                        | 一般消費財・サービス |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 123.25<br>10銘柄   | 910<br>120,860<br>< 0.4% >   |            |
| ユーロ (ルクセンブルグ)                | 株数               | 千ユーロ             | 千円                           |            |
| RTL GROUP                    | 3.5              | 22               | 3,047                        | 一般消費財・サービス |
| ARCELOMITTAL                 | 43.44            | 111              | 14,829                       | 素材         |
| EUROFINS SCIENTIFIC          | 0.6              | 30               | 4,038                        | ヘルスケア      |
| SES                          | 19               | 25               | 3,385                        | 一般消費財・サービス |
| TENARIS SA                   | 22               | 26               | 3,544                        | エネルギー      |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 88.54<br>5銘柄     | 217<br>28,845<br>< 0.1% >    |            |
| ユーロ (フランス)                   | 株数               | 千ユーロ             | 千円                           |            |
| JCDECAUX SA                  | 8.45             | 29               | 3,879                        | 一般消費財・サービス |
| TOTAL SA                     | 152.31           | 726              | 96,499                       | エネルギー      |
| MICHELIN (CGDE)              | 11.5             | 140              | 18,679                       | 一般消費財・サービス |
| AIR LIQUIDE SA               | 28.45            | 299              | 39,824                       | 素材         |
| KERING                       | 5.12             | 192              | 25,560                       | 一般消費財・サービス |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 34.29            | 248              | 33,012                       | 資本財・サービス   |
| BOUYGUES SA                  | 12.5             | 53               | 7,170                        | 資本財・サービス   |
| BNP PARIBAS                  | 70.25            | 451              | 59,981                       | 金融         |
| PEUGEOT SA                   | 28.73            | 49               | 6,599                        | 一般消費財・サービス |
| NATIXIS                      | 76.74            | 51               | 6,814                        | 金融         |
| THALES SA                    | 6                | 50               | 6,693                        | 資本財・サービス   |
| DANONE                       | 39.26            | 280              | 37,244                       | 生活必需品      |
| CARREFOUR SA                 | 33.1             | 58               | 7,816                        | 生活必需品      |
| SUEZ                         | 29.5             | 46               | 6,115                        | 公益事業       |
| VIVENDI                      | 69.25            | 157              | 20,886                       | 一般消費財・サービス |
| L'OREAL                      | 15.5             | 289              | 38,484                       | 生活必需品      |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN    | 32.89            | 159              | 21,191                       | 資本財・サービス   |
| LEGRAND SA                   | 17.5             | 109              | 14,551                       | 資本財・サービス   |
| CASINO GUICHARD PERRACHON    | 2                | 10               | 1,359                        | 生活必需品      |
| PERNOD RICARD SA             | 13.03            | 170              | 22,600                       | 生活必需品      |
| SOCIETE BIC SA               | 1.5              | 14               | 1,897                        | 資本財・サービス   |
| EURAZEO SA                   | 1.59             | 11               | 1,538                        | 金融         |

| 銘柄                           | 株数               | 2017年11月30日現在    |                                | 業種等        |
|------------------------------|------------------|------------------|--------------------------------|------------|
|                              |                  | 評価額              | 価額                             |            |
|                              |                  | 外貨建金額            | 邦貨換算金額                         |            |
| REXEL SA                     | 16               | 24               | 3,300                          | 資本財・サービス   |
| SOCIETE GENERALE SA          | 46.26            | 198              | 26,353                         | 金融         |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 17.1             | 419              | 55,663                         | 一般消費財・サービス |
| ACCOR SA                     | 10               | 42               | 5,600                          | 一般消費財・サービス |
| CAPGEMINI SE                 | 9.3              | 90               | 12,030                         | 情報技術       |
| VALEO SA                     | 15.12            | 91               | 12,199                         | 一般消費財・サービス |
| PUBLICIS GROUPE              | 13               | 72               | 9,668                          | 一般消費財・サービス |
| BUREAU VERITAS SA            | 17               | 37               | 5,024                          | 資本財・サービス   |
| EIFFAGE                      | 4                | 36               | 4,913                          | 資本財・サービス   |
| SODEXO SA                    | 6.69             | 73               | 9,746                          | 一般消費財・サービス |
| IPSEN                        | 2.76             | 28               | 3,793                          | ヘルスケア      |
| INGENICO GROUP               | 4.99             | 43               | 5,745                          | 情報技術       |
| ZODIAC AEROSPACE             | 8                | 19               | 2,622                          | 資本財・サービス   |
| SEB SA                       | 1.97             | 30               | 4,106                          | 一般消費財・サービス |
| ESSILOR INTERNATIONAL        | 11.9             | 126              | 16,863                         | ヘルスケア      |
| DASSAULT AVIATION SA         | 0.22             | 28               | 3,792                          | 資本財・サービス   |
| AXA SA                       | 123.65           | 315              | 41,908                         | 金融         |
| LAGARDERE SCA                | 12               | 32               | 4,347                          | 一般消費財・サービス |
| EDENRED                      | 19.13            | 46               | 6,162                          | 資本財・サービス   |
| RENAULT SA                   | 12               | 102              | 13,672                         | 一般消費財・サービス |
| HERMES INTERNATIONAL         | 2.04             | 89               | 11,834                         | 一般消費財・サービス |
| REMY COINTREAU               | 2.53             | 27               | 3,714                          | 生活必需品      |
| ATOS SE                      | 6.43             | 79               | 10,550                         | 情報技術       |
| DASSAULT SYSTEMES SA         | 8.99             | 80               | 10,637                         | 情報技術       |
| WENDEL                       | 2.01             | 28               | 3,747                          | 金融         |
| ORANGE                       | 121.29           | 175              | 23,292                         | 電気通信サービス   |
| ALSTOM                       | 13.1             | 45               | 6,023                          | 資本財・サービス   |
| CNP ASSURANCES               | 13.49            | 25               | 3,391                          | 金融         |
| SANOFI                       | 72.79            | 560              | 74,418                         | ヘルスケア      |
| VINCI SA                     | 31.06            | 269              | 35,846                         | 資本財・サービス   |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 23.63            | 50               | 6,686                          | 公益事業       |
| CREDIT AGRICOLE SA           | 76.58            | 108              | 14,421                         | 金融         |
| ENGIE                        | 123.26           | 182              | 24,227                         | 公益事業       |
| IMERYS SA                    | 3.4              | 26               | 3,472                          | 素材         |
| EDF                          | 34               | 38               | 5,102                          | 公益事業       |
| SAFRAN SA                    | 18.5             | 167              | 22,218                         | 資本財・サービス   |
| ILIAD SA                     | 2.19             | 43               | 5,732                          | 電気通信サービス   |
| ARKEMA                       | 4.8              | 49               | 6,531                          | 素材         |
| ADP                          | 1                | 15               | 2,109                          | 資本財・サービス   |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS      | 14               | 26               | 3,523                          | 一般消費財・サービス |
| SCOR SE                      | 12.97            | 44               | 5,945                          | 金融         |
| GROUPE EURO TUNNEL SE - REGR | 39.4             | 43               | 5,763                          | 資本財・サービス   |
| BOLLORE                      | 73               | 32               | 4,314                          | 資本財・サービス   |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,741.01<br>65銘柄 | 7,675<br>1,019,425<br>< 3.8% > |            |
| ユーロ (ドイツ)                    | 株数               | 千ユーロ             | 千円                             |            |
| BAYER AG-REG                 | 53.6             | 579              | 76,916                         | ヘルスケア      |
| EVONIK INDUSTRIES AG         | 6                | 18               | 2,477                          | 素材         |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED  | 136.93           | 220              | 29,224                         | 金融         |
| COMMERZBANK AG               | 72.89            | 88               | 11,747                         | 金融         |
| VOLKSWAGEN AG                | 2.2              | 37               | 5,022                          | 一般消費財・サービス |
| VOLKSWAGEN AG-PREF           | 11.72            | 207              | 27,503                         | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                                                       | 2017年11月30日現在    |                  |                  | 業 種 等      |
|----------------------------------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------|
|                                                          | 株 数              | 評 価 額            | 外貨建金額 邦貨換算金額     |            |
|                                                          | 百株               | 千ユーロ             | 千円               |            |
| MAN SE                                                   | 1                | 9                | 1,257            | 資本財・サービス   |
| SIEMENS AG-REG                                           | 49.62            | 568              | 75,455           | 資本財・サービス   |
| E.ON SE                                                  | 128.43           | 126              | 16,799           | 公益事業       |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG                              | 19.96            | 169              | 22,460           | 一般消費財・サービス |
| GEA GROUP AG                                             | 13               | 52               | 6,945            | 資本財・サービス   |
| OSRAM LIGHT AG                                           | 6.45             | 45               | 6,004            | 資本財・サービス   |
| CONTINENTAL AG                                           | 7.5              | 164              | 21,878           | 一般消費財・サービス |
| BASF SE                                                  | 57.14            | 535              | 71,053           | 素材         |
| K+S AG-REG                                               | 14               | 27               | 3,666            | 素材         |
| ALLIANZ SE-REG                                           | 28.61            | 572              | 76,031           | 金融         |
| THYSENKRUPP AG                                           | 26.3             | 60               | 8,094            | 素材         |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG                               | 11.2             | 127              | 16,919           | 生活必需品      |
| RWVE AG                                                  | 33.07            | 64               | 8,621            | 公益事業       |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG                                   | 17               | 48               | 6,477            | 資本財・サービス   |
| FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT                             | 1.1              | 9                | 1,227            | 資本財・サービス   |
| BRENNTAG AG                                              | 8                | 41               | 5,547            | 資本財・サービス   |
| FRESENIUS SE & CO KGAA                                   | 25.42            | 153              | 20,451           | ヘルスケア      |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE                             | 9.59             | 52               | 7,017            | 情報技術       |
| HOCHTIEF AG                                              | 1.66             | 24               | 3,232            | 資本財・サービス   |
| SAP SE                                                   | 64.24            | 612              | 81,341           | 情報技術       |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG                               | 10.36            | 199              | 26,445           | 金融         |
| SCHAEFFLER AG                                            | 21.02            | 30               | 4,068            | 一般消費財・サービス |
| ZALANDO SE                                               | 7                | 30               | 3,997            | 一般消費財・サービス |
| HEIDELBERGCEMENT AG                                      | 9                | 80               | 10,660           | 素材         |
| KION GROUP AG                                            | 6                | 41               | 5,506            | 資本財・サービス   |
| COVESTRO AG                                              | 8.03             | 69               | 9,277            | 素材         |
| INNOGY SE                                                | 6                | 23               | 3,131            | 公益事業       |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF                               | 8                | 56               | 7,532            | 一般消費財・サービス |
| METRO AG                                                 | 15               | 24               | 3,250            | 生活必需品      |
| LINDE AG - TENDER                                        | 11.63            | 228              | 30,320           | 素材         |
| BEIERSDORF AG                                            | 8.15             | 80               | 10,648           | 生活必需品      |
| FUCHS PETROLUB SE -PREF                                  | 7                | 30               | 4,071            | 素材         |
| MERCK KGAA                                               | 8.12             | 73               | 9,757            | ヘルスケア      |
| ADIDAS AG                                                | 12.57            | 223              | 29,657           | 一般消費財・サービス |
| HENKEL AG & CO KGAA                                      | 6.5              | 66               | 8,844            | 生活必需品      |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG                                  | 211.13           | 312              | 41,527           | 電気通信サービス   |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAWMLER AG-REGISTERED SHARES | 13.67            | 113              | 15,046           | ヘルスケア      |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG                                 | 60.01            | 420              | 55,893           | 一般消費財・サービス |
| HANNOVER RUECK SE                                        | 70.1             | 162              | 21,617           | 情報技術       |
| DEUTSCHE POST AG-REG                                     | 3.5              | 38               | 5,157            | 金融         |
| DEUTSCHE BOERSE AG                                       | 58.59            | 233              | 31,004           | 資本財・サービス   |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE                                  | 12.74            | 120              | 15,977           | 金融         |
| LANXESS AG                                               | 15.6             | 42               | 5,610            | 一般消費財・サービス |
| AXEL SPRINGER SE                                         | 6                | 37               | 5,039            | 素材         |
| DEUTSCHE WOHNEN SE                                       | 4.7              | 30               | 4,114            | 一般消費財・サービス |
| SYMRIS AG                                                | 23.63            | 86               | 11,534           | 不動産        |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI                             | 8.3              | 58               | 7,762            | 素材         |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF                             | 62.4             | 24               | 3,298            | 電気通信サービス   |
| HUGO BOSS AG -ORD                                        | 2.5              | 18               | 2,420            | 一般消費財・サービス |
| VONOVIA SE                                               | 3.5              | 24               | 3,200            | 一般消費財・サービス |
|                                                          | 27.6             | 107              | 14,304           | 不動産        |
| 国 小 計                                                    | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,534.98<br>57銘柄 | 7,710<br>< 3.8%> | 1,024,060  |

| 銘柄                           | 2017年11月30日現在    |                  |                  | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------|
|                              | 株 数              | 評 価 額            | 外貨建金額 邦貨換算金額     |            |
|                              | 百株               | 千ユーロ             | 千円               |            |
| ユーロ (ポルトガル)                  | 百株               | 千ユーロ             | 千円               |            |
| JERONIMO MARTINS             | 8                | 13               | 1,772            | 生活必需品      |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA  | 151              | 43               | 5,831            | 公益事業       |
| GALP ENERGIA SGPS SA         | 36.09            | 57               | 7,671            | エネルギー      |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 195.09<br>3銘柄    | 115<br>< 0.1%>   | 15,275     |
| ユーロ (スペイン)                   | 百株               | 千ユーロ             | 千円               |            |
| TELEFONICA SA                | 278.32           | 241              | 32,017           | 電気通信サービス   |
| ENDESA SA                    | 21.5             | 40               | 5,422            | 公益事業       |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 424.92           | 309              | 41,078           | 金融         |
| IBERDROLA SA                 | 368.4            | 245              | 32,658           | 公益事業       |
| BANCO DE SABADELL SA         | 325.87           | 55               | 7,405            | 金融         |
| BANKINTER SA                 | 67               | 54               | 7,192            | 金融         |
| REPSOL SA                    | 83.17            | 128              | 17,032           | エネルギー      |
| GRIFOLS SA                   | 17               | 41               | 5,543            | ヘルスケア      |
| BANCO SANTANDER SA           | 1,025.73         | 585              | 77,703           | 金融         |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA  | 48.29            | 89               | 11,941           | 資本財・サービス   |
| AMADEUS IT GROUP SA          | 26.68            | 162              | 21,625           | 情報技術       |
| GAS NATURAL SDG SA           | 21               | 39               | 5,257            | 公益事業       |
| MAPFRE SA                    | 80.05            | 22               | 3,036            | 金融         |
| CAIXABANK S.A                | 219.87           | 88               | 11,814           | 金融         |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI | 49               | 34               | 4,515            | 資本財・サービス   |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV  | 12               | 39               | 5,229            | 資本財・サービス   |
| AENA SME SA                  | 4                | 67               | 8,999            | 資本財・サービス   |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL   | 69.28            | 206              | 27,396           | 一般消費財・サービス |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | 17.93            | 18               | 2,514            | 資本財・サービス   |
| ENAGAS SA                    | 18.59            | 45               | 6,035            | エネルギー      |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 23               | 43               | 5,783            | 公益事業       |
| FERROVIAL SA                 | 38.76            | 71               | 9,523            | 資本財・サービス   |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL  | 32               | 12               | 1,678            | 生活必需品      |
| BANKIA SA                    | 72.87            | 29               | 3,913            | 金融         |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 3,345.23<br>24銘柄 | 2,675<br>< 1.3%> | 355,321    |
| ユーロ (イタリア)                   | 百株               | 千ユーロ             | 千円               |            |
| UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA  | 130              | 24               | 3,313            | 金融         |
| PRYSMIAN SPA                 | 14.4             | 40               | 5,324            | 資本財・サービス   |
| ASSICURAZIONI GENERALI       | 75.23            | 114              | 15,196           | 金融         |
| SAIPEM SPA                   | 71.63            | 24               | 3,310            | エネルギー      |
| MEDIOBANCA SPA               | 44.6             | 42               | 5,633            | 金融         |
| UNICREDIT SPA                | 123.35           | 210              | 27,915           | 金融         |
| TELECOM ITALIA SPA           | 613              | 42               | 5,702            | 電気通信サービス   |
| TELECOM ITALIA-RSP           | 483.81           | 27               | 3,685            | 電気通信サービス   |
| INTESA SANPAOLO-RSP          | 93.84            | 24               | 3,315            | 金融         |
| INTESA SANPAOLO              | 837.01           | 236              | 31,348           | 金融         |
| ATLANTIA SPA                 | 26.77            | 74               | 9,848            | 資本財・サービス   |
| POSTE ITALIANE SPA           | 29               | 17               | 2,366            | 金融         |
| RECORDATI SPA                | 6.92             | 26               | 3,457            | ヘルスケア      |
| ENI SPA                      | 163.64           | 225              | 29,904           | エネルギー      |
| LEONARDO SPA                 | 25               | 25               | 3,330            | 資本財・サービス   |
| ENEL SPA                     | 501.29           | 274              | 36,450           | 公益事業       |
| SNAM SPA                     | 162              | 68               | 9,100            | エネルギー      |
| LUXOTTICA GROUP SPA          | 13.07            | 62               | 8,338            | 一般消費財・サービス |

| 銘 柄                          |         | 2017年11月30日現在    |                      |                                | 業 種 等      |
|------------------------------|---------|------------------|----------------------|--------------------------------|------------|
|                              |         | 株 数              | 評 価 額                |                                |            |
|                              | 外貨建金額   |                  | 邦貨換算金額               |                                |            |
| TERNA SPA                    |         | 百株<br>99         | 千ユーロ<br>51           | 千円<br>6,817                    | 公益事業       |
| 国 小 計                        | 株数、金額   | 3,513.56         | 1,614                | 214,359                        |            |
|                              | 銘柄数<比率> | 19銘柄             |                      | < 0.8%>                        |            |
| ユーロ（フィンランド）                  |         | 百株               | 千ユーロ                 | 千円                             |            |
| UPM-KYMMENE OYJ              |         | 31.7             | 81                   | 10,807                         | 素材         |
| NOKIA OYJ                    |         | 364.94           | 153                  | 20,404                         | 情報技術       |
| WARTSILA OYJ ABP             |         | 8.5              | 47                   | 6,254                          | 資本財・サービス   |
| STORA ENSO OYJ-R SHS         |         | 41.93            | 54                   | 7,272                          | 素材         |
| METSO OYJ                    |         | 11.08            | 32                   | 4,382                          | 資本財・サービス   |
| ELISA OYJ                    |         | 13               | 44                   | 5,858                          | 電気通信サービス   |
| SAMPO OYJ-A SHS              |         | 29.29            | 130                  | 17,341                         | 金融         |
| FORTUM OYJ                   |         | 24               | 42                   | 5,587                          | 公益事業       |
| KONE OYJ-B                   |         | 19.28            | 83                   | 11,141                         | 資本財・サービス   |
| NOKIAN RENKAAT OYJ           |         | 7                | 25                   | 3,390                          | 一般消費財・サービス |
| NESTE OYJ                    |         | 11               | 55                   | 7,392                          | エネルギー      |
| ORION OYJ-CLASS B            |         | 5                | 16                   | 2,146                          | ヘルスケア      |
| 国 小 計                        | 株数、金額   | 566.72           | 767                  | 101,978                        |            |
|                              | 銘柄数<比率> | 12銘柄             |                      | < 0.4%>                        |            |
| ユーロ（オーストリア）                  |         | 百株               | 千ユーロ                 | 千円                             |            |
| OMV AG                       |         | 6                | 31                   | 4,153                          | エネルギー      |
| ERSTE GROUP BANK AG          |         | 20               | 73                   | 9,704                          | 金融         |
| VOESTALPINE AG               |         | 8                | 39                   | 5,208                          | 素材         |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA |         | 11               | 33                   | 4,411                          | 金融         |
| ANDRITZ AG                   |         | 5.5              | 25                   | 3,386                          | 資本財・サービス   |
| 国 小 計                        | 株数、金額   | 50.5             | 202                  | 26,864                         |            |
|                              | 銘柄数<比率> | 5銘柄              |                      | < 0.1%>                        |            |
| ユーロ（その他）                     |         | 百株               | 千ユーロ                 | 千円                             |            |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  |         | 13               | 42                   | 5,588                          | 生活必需品      |
| STMICROELECTRONICS NV        |         | 33.17            | 62                   | 8,301                          | 情報技術       |
| 国 小 計                        | 株数、金額   | 46.17            | 104                  | 13,890                         |            |
|                              | 銘柄数<比率> | 2銘柄              |                      | < 0.1%>                        |            |
| ユーロ通貨計                       |         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 12,682.24<br>233銘柄   | 25,572<br>3,396,269<br><12.6%> |            |
| ファンド合計                       |         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 77,853.17<br>1,241銘柄 | —<br>25,105,407<br><92.9%>     |            |

(注1) 邦貨換算金額は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託受益証券

| 銘                            | 柄                | 2017年11月30日現在 |          |                 |
|------------------------------|------------------|---------------|----------|-----------------|
|                              |                  | 口数            | 評価額      |                 |
|                              |                  |               | 外貨建金額    | 邦貨換算金額          |
| (シンガポール)                     |                  | 千口            | 千アメリカ・ドル | 千円              |
| HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U |                  | 70            | 29       | 3,294           |
| アメリカ・ドル<br>通貨計               | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 70<br>1銘柄     | 29       | 3,294<br><0.0%> |

(注1) 邦貨換算金額は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託証券

| 銘柄                           | 2017年11月30日現在     |                |                 |
|------------------------------|-------------------|----------------|-----------------|
|                              | □ 数               | 評価額            |                 |
|                              |                   | 外貨建金額          | 邦貨換算金額          |
| (アメリカ)                       | 千口                | 千アメリカ・ドル       | 千円              |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 0.872             | 158            | 17,786          |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 1.894             | 300            | 33,686          |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 0.85              | 106            | 11,910          |
| GGP INC                      | 4                 | 93             | 10,487          |
| VORNADO REALTY TRUST         | 1.156             | 88             | 9,964           |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | 0.8               | 135            | 15,217          |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 2.25              | 150            | 16,825          |
| EQUINIX INC                  | 0.514             | 240            | 26,972          |
| AMERICAN TOWER CORP          | 2.8               | 409            | 45,900          |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 4.228             | 83             | 9,318           |
| KIMCO REALTY CORP            | 3.3               | 60             | 6,829           |
| COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A | 3.5               | 43             | 4,823           |
| VENTAS INC                   | 2.1               | 134            | 15,075          |
| WEYERHAEUSER CO              | 4.904             | 173            | 19,435          |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 2.1               | 42             | 4,722           |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | 1.4               | 25             | 2,861           |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 2.5               | 282            | 31,614          |
| IRON MOUNTAIN INC            | 1.718             | 69             | 7,800           |
| VEREIT INC                   | 7.75              | 60             | 6,816           |
| PROLOGIS INC                 | 3.415             | 225            | 25,304          |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 0.7               | 88             | 9,958           |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 0.65              | 59             | 6,670           |
| DUKE REALTY CORP             | 1.8               | 51             | 5,778           |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 0.45              | 111            | 12,488          |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 0.45              | 59             | 6,660           |
| WELLTOWER INC                | 2.35              | 158            | 17,716          |
| HCP INC                      | 2.8               | 75             | 8,439           |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 1                 | 44             | 4,999           |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 0.7               | 71             | 8,019           |
| MACERICH CO/THE              | 0.7               | 44             | 5,037           |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 6.3               | 74             | 8,308           |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 0.65              | 26             | 3,013           |
| REALTY INCOME CORP           | 1.8               | 99             | 11,187          |
| PUBLIC STORAGE               | 0.95              | 199            | 22,381          |
| REGENCY CENTERS CORP         | 1.15              | 78             | 8,762           |
| SL GREEN REALTY CORP         | 0.65              | 66             | 7,445           |
| UDR INC                      | 1.9               | 74             | 8,379           |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 1.45              | 169            | 19,007          |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 0.8               | 68             | 7,624           |
| アメリカ・ドル<br>通貨計               | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 79.301<br>39銘柄 | 4,509<br><1.9%> |

| 銘柄                           | 2017年11月30日現在     |                 |                 |
|------------------------------|-------------------|-----------------|-----------------|
|                              | □ 数               | 評価額             |                 |
|                              |                   | 外貨建金額           | 邦貨換算金額          |
| (カナダ)                        | 千口                | 千カナダ・ドル         | 千円              |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 2                 | 41              | 3,654           |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 1.4               | 34              | 3,031           |
| カナダ・ドル<br>通貨計                | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 3.4<br>2銘柄      | 76<br><0.0%>    |
| (オーストラリア)                    | 千口                | 千オーストラリア・ドル     | 千円              |
| LENDLEASE GROUP              | 4.303             | 69              | 5,879           |
| TRANSURBAN GROUP             | 11.52             | 144             | 12,299          |
| SYDNEY AIRPORT               | 9.129             | 68              | 5,810           |
| APA GROUP                    | 7.5               | 69              | 5,906           |
| SCENTRE GROUP                | 30.929            | 130             | 11,103          |
| DEXUS                        | 6.5               | 66              | 5,632           |
| GPT GROUP                    | 14.648            | 78              | 6,650           |
| MIRVAC GROUP                 | 31.638            | 77              | 6,551           |
| STOCKLAND                    | 14.3              | 66              | 5,679           |
| WESTFIELD CORP               | 13.956            | 116             | 9,901           |
| GOODMAN GROUP                | 8.8               | 76              | 6,505           |
| VICINITY CENTRES             | 19.523            | 54              | 4,606           |
| オーストラリア・ドル<br>通貨計            | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 172.746<br>12銘柄 | 1,019<br><0.3%> |
| (香港)                         | 千口                | 千香港ドル           | 千円              |
| LINK REIT                    | 13.5              | 949             | 13,628          |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | 34                | 336             | 4,825           |
| 香港・ドル<br>通貨計                 | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 47.5<br>2銘柄     | 1,285<br><0.1%> |
| (シンガポール)                     | 千口                | 千シンガポール・ドル      | 千円              |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 12                | 31              | 2,625           |
| CAPITALAND MALL TRUST        | 9                 | 18              | 1,542           |
| シンガポール・ドル<br>通貨計             | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 21<br>2銘柄       | 50<br><0.0%>    |
| (イギリス)                       | 千口                | 千イギリス・ポンド       | 千円              |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    | 4.808             | 44              | 6,721           |
| SEGRO PLC                    | 5.92              | 32              | 4,890           |
| HAMMERSON PLC                | 4.9               | 25              | 3,804           |
| BRITISH LAND CO PLC          | 6.3               | 39              | 5,909           |
| INTU PROPERTIES PLC          | 8.425             | 16              | 2,465           |
| イギリス・ポンド<br>通貨計              | □ 数、金額<br>銘柄数<比率> | 30.353<br>5銘柄   | 158<br><0.1%>   |
| (ユーロ (フランス))                 | 千口                | 千ユーロ            | 千円              |
| UNIBAIL-RODAMCO SE           | 0.609             | 132             | 17,583          |
| ICADE                        | 0.406             | 32              | 4,250           |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘 柄                  |         | 2017年11月30日現在 |       |         |
|----------------------|---------|---------------|-------|---------|
|                      |         | □ 数           | 評 価 額 |         |
|                      |         |               | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |
|                      |         | 千口            | 千ユーロ  | 千円      |
| GECINA SA            |         | 0.334         | 46    | 6,174   |
| KLEPIERRE            |         | 1.4           | 48    | 6,435   |
| FONCIERE DES REGIONS |         | 0.353         | 31    | 4,186   |
| ユーロ通貨計               | □ 数、金 額 | 3.102         | 290   | 38,630  |
|                      | 銘柄数<比率> | 5銘柄           |       | <0.1%>  |
| 合 計                  | □ 数、金 額 | 357.402       | —     | 683,496 |
|                      | 銘柄数<比率> | 67銘柄          |       | <2.5%>  |

(注1) 邦貨換算金額は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信先買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

| 銘 柄 別 |                               | 2017年11月30日現在 |          |
|-------|-------------------------------|---------------|----------|
|       |                               | 買 建 額         | 売 建 額    |
| 外 国   | S & P500 E-MINI FUTURE (アメリカ) | 百万円<br>750    | 百万円<br>— |
|       | S & P/TSE 60 INDEX (カナダ)      | 16            | —        |
|       | SPI 200 INDEX (オーストラリア)       | 12            | —        |
|       | FT 100 (イギリス)                 | 44            | —        |
|       | SMI (スイス)                     | 21            | —        |
|       | EURO STOXX 50 (ドイツ)           | 119           | —        |
|       |                               |               |          |

(注1) 外貨建の資産は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信先買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## 運用報告書 第9期（決算日 2017年1月10日）

（計算期間 2016年1月13日～2017年1月10日）

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの第9期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|             |                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運 用 方 針     | 信託財産の成長をめざして運用を行ないます。                                                                                                                                                                                                                                        |
| 主 要 投 資 対 象 | 海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）                                                                                                                                                                                                            |
| 運 用 方 法     | ①主として海外の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。<br>②保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。<br>③運用の効率化を図るため、株式指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等の組入総額ならびに株式指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 |
| 株 式 組 入 制 限 | 無制限                                                                                                                                                                                                                                                          |

## 大和投資信託

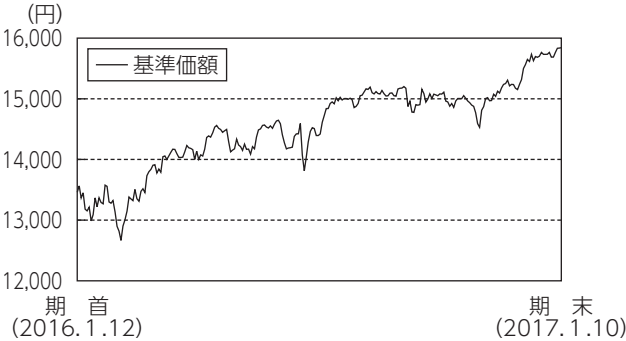
Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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



■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日          | 基 準 価 額 |       | MSCIコクサイ<br>指数(円ヘッジ・<br>ベース、指数化) |       | 株 式 先 物 |       | 投 資 信 託 証 券 |   |
|----------------|---------|-------|----------------------------------|-------|---------|-------|-------------|---|
|                | 円       | 騰落率   | 円                                | 騰落率   | 組 比     | 率     | 組 比         | 率 |
| (期首)2016年1月12日 | 13,460  | -     | 11,197                           | -     | 87.7%   | 7.3%  | 2.4%        |   |
| 1月末            | 13,269  | △ 1.4 | 11,041                           | △ 1.4 | 91.8%   | 7.6%  | 2.6%        |   |
| 2月末            | 13,517  | 0.4   | 11,221                           | 0.2   | 86.2%   | 5.6%  | 2.4%        |   |
| 3月末            | 14,229  | 5.7   | 11,780                           | 5.2   | 92.0%   | 6.5%  | 2.6%        |   |
| 4月末            | 14,495  | 7.7   | 11,985                           | 7.0   | 91.1%   | 4.4%  | 2.5%        |   |
| 5月末            | 14,568  | 8.2   | 12,002                           | 7.2   | 94.0%   | 6.7%  | 2.6%        |   |
| 6月末            | 14,290  | 6.2   | 11,747                           | 4.9   | 85.9%   | 4.7%  | 2.6%        |   |
| 7月末            | 14,992  | 11.4  | 12,320                           | 10.0  | 94.0%   | 4.4%  | 2.8%        |   |
| 8月末            | 15,097  | 12.2  | 12,376                           | 10.5  | 93.3%   | 4.8%  | 2.8%        |   |
| 9月末            | 15,006  | 11.5  | 12,287                           | 9.7   | 91.9%   | 3.6%  | 2.7%        |   |
| 10月末           | 14,896  | 10.7  | 12,190                           | 8.9   | 92.7%   | 7.5%  | 2.5%        |   |
| 11月末           | 15,238  | 13.2  | 12,449                           | 11.2  | 94.0%   | 10.3% | 2.3%        |   |
| 12月末           | 15,688  | 16.6  | 12,791                           | 14.2  | 92.0%   | 7.1%  | 2.4%        |   |
| (期末)2017年1月10日 | 15,841  | 17.7  | 12,919                           | 15.4  | 91.1%   | 5.6%  | 2.5%        |   |

(注1) 騰落率は期首比。  
(注2) MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース、指数化) は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。  
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。  
(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】  
期首：13,460円 期末：15,841円 騰落率：17.7%  
【基準価額の主な変動要因】

MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) の動きに連動させることをめざして運用を行なった結果、原油価格が上昇したことや、米国の新政権の政策への期待から外国株式市況が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○外国株式市況  
米国・欧州を中心とする外国株式市況は、期首より、中国株や中国・人民元の下落、原油価格の下落、欧州の一部大手銀行に対する信用不安などが嫌気され、軟調な推移で始まりました。2016年3月以降は、原油価格が反発したことやECB (欧州中央銀行) によ

る追加金融緩和の発表、FOMC (米国連邦公開市場委員会) での利上げ見送りなどが好感され堅調に推移しました。6月下旬に英国の国民投票でEU (欧州連合) 離脱派が多数となると欧州情勢への懸念が高まり、市況は一時的に急落しましたが、その後は英国および各国の中央銀行が政策協調を表明したことが好感され、落ち着いた動きを取り戻し反発しました。7月以降は、米国企業の良好な決算内容などを受けて上昇基調となりましたが、米国の利上げ観測が台頭すると一進一退の展開となりました。11月に入ると、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことによる新政権の政策への期待から、市況は米国市場を中心に上昇基調となり期末を迎えました。

◆前期における「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 (MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) ) の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なっておりま

◆ポートフォリオについて

外国株式 (投資信託証券、株式先物を含む。以下同じ。) と為替予約の評価損益の合計の純資産総額に対する比率については、期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。  
ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式等のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は15.4%となりました。一方、当ファンドの騰落率は17.7%となりました。  
ファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、かい離要因となりました。その他、ファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、売買手数料・保管費用等のコスト負担がかい離要因としてあげられます。

《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なっておりま

■1万口当りの費用の明細

| 項 目                                 | 当 期                     |
|-------------------------------------|-------------------------|
| 売買委託手数料<br>(株式)<br>(先物)<br>(投資信託証券) | 5円<br>(5)<br>(1)<br>(0) |
| 有価証券取引税<br>(株式)<br>(投資信託証券)         | 6<br>(6)<br>(0)         |
| その他費用<br>(保管費用)<br>(その他)            | 21<br>(19)<br>(2)       |
| 合 計                                 | 32                      |

(注1) 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、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。  
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2016年1月13日から2017年1月10日まで)

|   |                  | 買 付                         |                                | 売 付          |                       |
|---|------------------|-----------------------------|--------------------------------|--------------|-----------------------|
|   |                  | 株 数                         | 金 額                            | 株 数          | 金 額                   |
| 外 | アメリカ             | 百株<br>5,623.95<br>(△ 44.68) | 千アメリカ・ドル<br>34,844<br>(△ 537)  | 百株<br>532.07 | 千アメリカ・ドル<br>2,590     |
|   | カナダ              | 百株<br>912.5<br>( 3.95)      | 千カナダ・ドル<br>3,559<br>( ー)       | 百株<br>182.57 | 千カナダ・ドル<br>753        |
|   | オーストラリア          | 百株<br>1,703.5<br>(△ 10.83)  | 千オーストラリア・ドル<br>2,365<br>(△ 18) | 百株<br>299.31 | 千オーストラリア・ドル<br>394    |
|   | 香港               | 百株<br>1,911<br>( 19.21)     | 千香港ドル<br>6,638<br>( ー)         | 百株<br>440    | 千香港ドル<br>1,556        |
|   | シンガポール           | 百株<br>1,187<br>( ー)         | 千シンガポール・ドル<br>445<br>(△ 0)     | 百株<br>193.18 | 千シンガポール・ドル<br>70      |
|   | ニュージーランド         | 百株<br>181<br>( ー)           | 千ニュージーランド・ドル<br>59<br>( ー)     | 百株<br>56     | 千ニュージーランド・ドル<br>21    |
|   | イギリス             | 百株<br>5,342.5<br>(△ 68.45)  | 千イギリス・ポンド<br>2,954<br>(△ 85)   | 百株<br>23.23  | 千イギリス・ポンド<br>19       |
|   | イスラエル            | 百株<br>42<br>( ー)            | 千イスラエル・シェケル<br>275<br>( ー)     | 百株<br>20     | 千イスラエル・シェケル<br>320    |
|   | スイス              | 百株<br>361.8<br>( ー)         | 千スイス・フラン<br>2,302<br>(△ 18)    | 百株<br>77.25  | 千スイス・フラン<br>427       |
|   | デンマーク            | 百株<br>91.16<br>( ー)         | 千デンマーク・クローネ<br>3,053<br>( ー)   | 百株<br>14     | 千デンマーク・クローネ<br>438    |
|   | ノルウェー            | 百株<br>107.5<br>( ー)         | 千ノルウェー・クローネ<br>1,518<br>(△ 1)  | 百株<br>7      | 千ノルウェー・クローネ<br>220    |
|   | スウェーデン           | 百株<br>621<br>( ー)           | 千スウェーデン・クローネ<br>7,565<br>(△ 9) | 百株<br>193    | 千スウェーデン・クローネ<br>1,874 |
|   | ユーロ<br>(アイルランド)  | 百株<br>1,317<br>( ー)         | 千ユーロ<br>107<br>( ー)            | 百株<br>ー      | 千ユーロ<br>ー             |
|   | ユーロ<br>(オランダ)    | 百株<br>339<br>( 6.51)        | 千ユーロ<br>686<br>(△ 2)           | 百株<br>16.5   | 千ユーロ<br>46            |
|   | ユーロ<br>(ベルギー)    | 百株<br>35.5<br>(△ 1.5)       | 千ユーロ<br>268<br>( ー)            | 百株<br>2.8    | 千ユーロ<br>27            |
| 国 | ユーロ<br>(ルクセンブルグ) | 百株<br>73.6<br>( ー)          | 千ユーロ<br>96<br>(△ 0)            | 百株<br>ー      | 千ユーロ<br>ー             |
|   | ユーロ<br>(フランス)    | 百株<br>420.9<br>( 2.64)      | 千ユーロ<br>1,753<br>( 3)          | 百株<br>60     | 千ユーロ<br>28            |
|   | ユーロ<br>(ドイツ)     | 百株<br>401.6<br>( 2.95)      | 千ユーロ<br>1,763<br>(△ 2)         | 百株<br>8.95   | 千ユーロ<br>31            |
|   | ユーロ<br>(ポルトガル)   | 百株<br>18<br>( ー)            | 千ユーロ<br>22<br>( ー)             | 百株<br>ー      | 千ユーロ<br>ー             |

|   |                 | 買 付                        |                        | 売 付          |             |
|---|-----------------|----------------------------|------------------------|--------------|-------------|
|   |                 | 株 数                        | 金 額                    | 株 数          | 金 額         |
| 外 | ユーロ<br>(スペイン)   | 百株<br>857<br>( 138.05)     | 千ユーロ<br>604<br>( 4)    | 百株<br>5      | 千ユーロ<br>15  |
|   | ユーロ<br>(イタリア)   | 百株<br>728.5<br>( 18.47)    | 千ユーロ<br>290<br>(△ 0)   | 百株<br>93.66  | 千ユーロ<br>16  |
|   | ユーロ<br>(フィンランド) | 百株<br>194.5<br>( ー)        | 千ユーロ<br>198<br>( ー)    | 百株<br>35     | 千ユーロ<br>17  |
|   | ユーロ<br>(オーストリア) | 百株<br>12.5<br>( ー)         | 千ユーロ<br>40<br>(△ 0)    | 百株<br>ー      | 千ユーロ<br>ー   |
|   | ユーロ<br>(その他)    | 百株<br>ー<br>( 5)            | 千ユーロ<br>ー<br>( 15)     | 百株<br>ー      | 千ユーロ<br>ー   |
|   | ユーロ<br>(ユーロ通貨計) | 百株<br>4,398.1<br>( 172.12) | 千ユーロ<br>5,834<br>( 15) | 百株<br>221.91 | 千ユーロ<br>183 |
| 国 |                 |                            |                        |              |             |
|   |                 |                            |                        |              |             |
|   |                 |                            |                        |              |             |
|   |                 |                            |                        |              |             |

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

(2) 投資信託証券

(2016年1月13日から2017年1月10日まで)

|   |               | 買 付                    |                            | 売 付                |                           |
|---|---------------|------------------------|----------------------------|--------------------|---------------------------|
|   |               | 口 数                    | 金 額                        | 口 数                | 金 額                       |
| 外 | アメリカ          | 千口<br>24.02<br>( 0.83) | 千アメリカ・ドル<br>1,215<br>( 8)  | 千口<br>0.49<br>( ー) | 千アメリカ・ドル<br>35<br>( ー)    |
|   | オーストラリア       | 千口<br>40.3<br>( ー)     | 千オーストラリア・ドル<br>194<br>( ー) | 千口<br>4.9<br>( ー)  | 千オーストラリア・ドル<br>25<br>( ー) |
|   | 香港            | 千口<br>6.5<br>( ー)      | 千香港ドル<br>349<br>( ー)       | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千香港ドル<br>ー<br>( ー)        |
|   | シンガポール        | 千口<br>12<br>( ー)       | 千シンガポール・ドル<br>29<br>(△ 0)  | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千シンガポール・ドル<br>ー<br>( ー)   |
|   | イギリス          | 千口<br>2.15<br>( ー)     | 千イギリス・ポンド<br>21<br>( ー)    | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千イギリス・ポンド<br>ー<br>( ー)    |
|   | ユーロ<br>(フランス) | 千口<br>0.76<br>( ー)     | 千ユーロ<br>82<br>( ー)         | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千ユーロ<br>ー<br>( ー)         |
| 国 |               |                        |                            |                    |                           |
|   |               |                        |                            |                    |                           |
|   |               |                        |                            |                    |                           |
|   |               |                        |                            |                    |                           |

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2016年1月13日から2017年1月10日まで)

| 種 類 別    | 買 建          |              | 売 建      |          |
|----------|--------------|--------------|----------|----------|
|          | 新規買付額        | 決 済 額        | 新規売付額    | 決 済 額    |
| 外国株式先物取引 | 百万円<br>4,458 | 百万円<br>4,266 | 百万円<br>－ | 百万円<br>－ |

(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

(2016年1月13日から2017年1月10日まで)

| 当                          |   |       |         | 期      |                                     |   |      |        |        |
|----------------------------|---|-------|---------|--------|-------------------------------------|---|------|--------|--------|
| 買                          |   | 付     |         | 売      |                                     | 付 |      |        |        |
| 銘                          | 柄 | 株 数   | 金 額     | 平均単価   | 銘                                   | 柄 | 株 数  | 金 額    | 平均単価   |
|                            |   | 千株    | 千円      | 円      |                                     |   | 千株   | 千円     | 円      |
| APPLE INC (アメリカ)           |   | 9.6   | 118,004 | 12,292 | NESTLE SA-REG (スイス)                 |   | 1.7  | 13,489 | 7,934  |
| MICROSOFT CORP (アメリカ)      |   | 13    | 84,012  | 6,462  | HOME DEPOT INC (アメリカ)               |   | 0.85 | 12,087 | 14,220 |
| EXXON MOBIL CORP (アメリカ)    |   | 7.85  | 75,566  | 9,626  | BANK OF NOVA SCOTIA (カナダ)           |   | 2    | 11,173 | 5,586  |
| AMAZON.COM INC (アメリカ)      |   | 0.69  | 58,912  | 85,380 | CANADIAN NATL RAILWAY CO (カナダ)      |   | 1.5  | 10,273 | 6,849  |
| GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ) |   | 17.65 | 58,510  | 3,315  | GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)          |   | 3    | 10,012 | 3,337  |
| JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)   |   | 4.6   | 58,233  | 12,659 | TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD (イスラエル) |   | 2    | 9,409  | 4,704  |
| NESTLE SA-REG (スイス)        |   | 7.2   | 57,241  | 7,950  | ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN (スイス) |   | 0.36 | 9,356  | 25,990 |
| FACEBOOK INC-A (アメリカ)      |   | 4.25  | 57,091  | 13,433 | TORONTO-DOMINION BANK (カナダ)         |   | 1.8  | 8,748  | 4,860  |
| JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ) |   | 6.1   | 48,423  | 7,938  | APPLE INC (アメリカ)                    |   | 0.75 | 7,988  | 10,651 |
| AT&T INC (アメリカ)            |   | 11.2  | 48,104  | 4,295  | COMCAST CORP-CLASS A (アメリカ)         |   | 1.2  | 7,929  | 6,607  |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

| 銘 柄                           | 期 首 |      | 当 期 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 SOLUTION | —   | 3.5  | 23       | 2,684  | 情報技術       |
| PALO ALTO NETWORKS INC        | 1   | 2.5  | 33       | 3,876  | 情報技術       |
| JARDEN CORP                   | 3   | —    | —        | —      | その他        |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC      | 1   | 1    | 11       | 1,351  | ヘルスケア      |
| SYNCHRONY FINANCIAL           | 10  | 27.5 | 101      | 11,767 | 金融         |
| ABBOTT LABORATORIES           | 23  | 55.7 | 226      | 26,313 | ヘルスケア      |
| ARCONIC INC                   | 18  | 15   | 30       | 3,546  | 資本財・サービス   |
| VERISK ANALYTICS INC          | 2   | 5    | 40       | 4,738  | 資本財・サービス   |
| LAS VEGAS SANDS CORP          | 6   | 14   | 77       | 9,044  | 一般消費財・サービス |
| AMPHENOL CORP-CL A            | 5   | 8    | 53       | 6,250  | 情報技術       |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV   | 4   | 10.5 | 81       | 9,501  | 情報技術       |
| QORVO INC                     | 2   | 2    | 10       | 1,260  | 情報技術       |
| AFLAC INC                     | 6   | 13.5 | 93       | 10,883 | 金融         |
| DARDEN RESTAURANTS INC        | 2   | 5    | 35       | 4,149  | 一般消費財・サービス |
| ADOBE SYSTEMS INC             | 7   | 16   | 173      | 20,143 | 情報技術       |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC    | 2   | 11   | 37       | 4,307  | 素材         |

| 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     |            |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 2    | 2     | 13       | 1,581  | 一般消費財・サービス |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL     | 5    | 5     | 9        | 1,117  | 金融         |
| GARMIN LTD                   | 2    | 2     | 9        | 1,115  | 一般消費財・サービス |
| AETNA INC                    | 5.94 | 10.44 | 128      | 14,912 | ヘルスケア      |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 3    | 6.5   | 95       | 11,027 | 素材         |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 11   | 22.5  | 264      | 30,669 | 資本財・サービス   |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC    | —    | 7     | 37       | 4,334  | 情報技術       |
| WR BERKLEY CORP              | 2    | 2     | 13       | 1,529  | 金融         |
| AUTOZONE INC                 | 0.6  | 1     | 79       | 9,164  | 一般消費財・サービス |
| DOLLAR TREE INC              | 4.49 | 8.49  | 65       | 7,594  | 一般消費財・サービス |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | —    | 32    | 112      | 13,009 | ヘルスケア      |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | —    | 5     | 38       | 4,477  | 公益事業       |
| CELANESE CORP-SERIES A       | 3    | 6     | 48       | 5,605  | 素材         |
| DR HORTON INC                | 6    | 14.5  | 40       | 4,701  | 一般消費財・サービス |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | —    | 4.5   | 22       | 2,610  | エネルギー      |
| DENTSPLY SIRONA INC          | —    | 7     | 40       | 4,746  | ヘルスケア      |

| 銘柄                            | 期 首   | 当 期 末  |                 | 業 種 等   |            |
|-------------------------------|-------|--------|-----------------|---------|------------|
|                               | 株 数   | 株 数    | 評 価 額           |         |            |
|                               |       |        | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |         |            |
|                               | 百株    | 百株     | 千アメリカ・ドル        | 千円      |            |
| AUTODESK INC                  | 4     | 7      | 55              | 6,460   | 情報技術       |
| MOODY'S CORP                  | 3     | 5.5    | 53              | 6,177   | 金融         |
| DEVON ENERGY CORP             | 7     | 13     | 60              | 7,021   | エネルギー      |
| ALBEMARLE CORP                | —     | 3      | 27              | 3,147   | 素材         |
| ATMOS ENERGY CORP             | —     | 3      | 21              | 2,546   | 公益事業       |
| ALLIANT ENERGY CORP           | 3     | 6      | 22              | 2,593   | 公益事業       |
| CITIGROUP INC                 | 43.8  | 91.8   | 552             | 64,104  | 金融         |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING     | 6     | 14     | 143             | 16,635  | 情報技術       |
| AMERICAN ELECTRIC POWER       | 5.5   | 16.5   | 102             | 11,922  | 公益事業       |
| ALLEGHANY CORP                | —     | 0.3    | 18              | 2,096   | 金融         |
| DUN & BRADSTREET CORP         | 1     | 1      | 12              | 1,427   | 資本財・サービス   |
| DOMINO'S PIZZA INC            | —     | 1.5    | 24              | 2,861   | 一般消費財・サービス |
| HESS CORP                     | 4     | 8.5    | 51              | 5,974   | エネルギー      |
| DAVITA INC                    | 2     | 6      | 38              | 4,409   | ヘルスケア      |
| DANAHER CORP                  | 8     | 19     | 153             | 17,755  | ヘルスケア      |
| FORTIVE CORP                  | —     | 10     | 53              | 6,230   | 資本財・サービス   |
| AVNET INC                     | —     | 4      | 18              | 2,172   | 情報技術       |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 1.85  | 18.25  | 104             | 12,066  | 金融         |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A      | 2     | 2      | 6               | 706     | 一般消費財・サービス |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C      | —     | 2.01   | 5               | 629     | 一般消費財・サービス |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO     | 10    | 19.5   | 87              | 10,118  | 生活必需品      |
| BUNGE LTD                     | 3     | 3      | 21              | 2,440   | 生活必需品      |
| TE CONNECTIVITY LTD           | 5.5   | 13     | 87              | 10,146  | 情報技術       |
| APPLE INC                     | 83    | 171.5  | 2,040           | 236,637 | 情報技術       |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES   | 6     | 14     | 100             | 11,627  | 金融         |
| BOEING CO/THE                 | 9.5   | 18.5   | 292             | 33,963  | 資本財・サービス   |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP     | 3     | 6      | 44              | 5,183   | 金融         |
| SPECTRA ENERGY CORP           | 10    | 23.5   | 99              | 11,546  | エネルギー      |
| BECTON DICKINSON AND CO       | 2.73  | 6.73   | 113             | 13,178  | ヘルスケア      |
| CDK GLOBAL INC                | —     | 6      | 36              | 4,187   | 情報技術       |
| NISOURCE INC                  | —     | 9      | 19              | 2,302   | 公益事業       |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP       | 5     | —      | —               | —       | その他        |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC   | 3     | 3      | 21              | 2,545   | 資本財・サービス   |
| CR BARD INC                   | 1     | 2      | 46              | 5,337   | ヘルスケア      |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP  | 16    | 32     | 152             | 17,677  | 金融         |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC    | 58.94 | 127.44 | 671             | 77,850  | 電気通信サービス   |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B   | 17    | 37     | 599             | 69,515  | 金融         |
| ANSYS INC                     | —     | 2      | 18              | 2,186   | 情報技術       |
| H&R BLOCK INC                 | 3     | 3      | 7               | 820     | 一般消費財・サービス |
| BB&T CORP                     | 12    | 24.5   | 114             | 13,276  | 金融         |
| BROADCOM CORP-CL A            | 8     | —      | —               | —       | その他        |
| BAKER HUGHES INC              | 6.81  | 13.81  | 87              | 10,127  | エネルギー      |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO       | 24    | 52.5   | 313             | 36,363  | ヘルスケア      |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO     | 1     | 1      | 7               | 879     | 生活必需品      |
| JPMORGAN CHASE & CO           | 55    | 113    | 973             | 112,925 | 金融         |
| LEGG MASON INC                | 3     | —      | —               | —       | 金融         |
| T ROWE PRICE GROUP INC        | 4     | 7.5    | 54              | 6,334   | 金融         |
| CIGNA CORP                    | 3.5   | 8      | 113             | 13,205  | ヘルスケア      |
| LKQ CORP                      | 5     | 12     | 37              | 4,340   | 一般消費財・サービス |
| COMPUTER SCIENCES CORP        | —     | 5      | 29              | 3,467   | 情報技術       |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD      | —     | 2      | 27              | 3,146   | 金融         |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP  | 19.21 | 19.21  | 7               | 819     | 電気通信サービス   |

| 銘柄                           | 期 首   |       | 当 期 末    |        | 業 種 等      |
|------------------------------|-------|-------|----------|--------|------------|
|                              | 株 数   | 株 数   | 評 価 額    |        |            |
|                              |       |       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株    | 百株    | 千アメリカ・ドル | 千円     |            |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 1     | 9     | 40       | 4,670  | 生活必需品      |
| CADENCE DESIGN SYS INC       | —     | 8     | 20       | 2,385  | 情報技術       |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 3     | 5.5   | 63       | 7,347  | 金融         |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 4     | 7.5   | 55       | 6,412  | 一般消費財・サービス |
| SERVICENOW INC               | 3     | 6     | 49       | 5,705  | 情報技術       |
| CATERPILLAR INC              | 9     | 17.5  | 161      | 18,744 | 資本財・サービス   |
| CMS ENERGY CORP              | 5     | 11    | 45       | 5,303  | 公益事業       |
| MOSAIC CO/THE                | 7     | 7     | 21       | 2,492  | 素材         |
| DELTA AIR LINES INC          | 4     | 4     | 19       | 2,304  | 資本財・サービス   |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO    | 3     | 7     | 50       | 5,811  | 生活必需品      |
| CORNING INC                  | 21    | 31    | 75       | 8,796  | 情報技術       |
| CISCO SYSTEMS INC            | 73    | 157.5 | 475      | 55,119 | 情報技術       |
| DU PONT (E.I.) DE NEMOURS    | 13    | 26    | 191      | 22,226 | 素材         |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC    | 2     | —     | —        | —      | ヘルスケア      |
| MORGAN STANLEY               | 23    | 43.5  | 185      | 21,544 | 金融         |
| WABCO HOLDINGS INC           | —     | 1.2   | 12       | 1,462  | 資本財・サービス   |
| DOW CHEMICAL CO/THE          | 16    | 33.5  | 193      | 22,449 | 素材         |
| MSCI INC                     | —     | 1.5   | 12       | 1,438  | 金融         |
| MIDDLEBY CORP                | —     | 2     | 26       | 3,038  | 資本財・サービス   |
| COTY INC-CL A                | —     | 11.17 | 21       | 2,441  | 生活必需品      |
| BROADCOM LTD                 | 4     | 11.84 | 209      | 24,297 | 情報技術       |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     | —     | 1     | 14       | 1,714  | ヘルスケア      |
| ENSCO PLC-CL A               | 4     | —     | —        | —      | エネルギー      |
| DICK'S SPORTING GOODS INC    | —     | 2     | 10       | 1,248  | 一般消費財・サービス |
| ACUITY BRANDS INC            | 1     | 1     | 20       | 2,348  | 資本財・サービス   |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 1     | —     | —        | —      | ヘルスケア      |
| ARAMARK                      | —     | 10    | 34       | 4,023  | 一般消費財・サービス |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | —     | 5     | 13       | 1,600  | 素材         |
| DTE ENERGY COMPANY           | 2     | 5     | 48       | 5,675  | 公益事業       |
| CENTENE CORP                 | 2     | 5     | 30       | 3,593  | ヘルスケア      |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 6     | 15.5  | 55       | 6,413  | 金融         |
| ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS | 4     | —     | —        | —      | その他        |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | —     | 7.5   | 39       | 4,557  | 金融         |
| GARTNER INC                  | —     | 2.5   | 23       | 2,777  | 情報技術       |
| SPLUNK INC                   | 2     | 6.5   | 36       | 4,197  | 情報技術       |
| WHITEWAVE FOODS CO           | 3     | 7.5   | 41       | 4,811  | 生活必需品      |
| AGCO CORP                    | 1     | 1     | 6        | 701    | 資本財・サービス   |
| DOMINION RESOURCES INC/VA    | 9     | 18.5  | 140      | 16,243 | 公益事業       |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 2     | 10.5  | 46       | 5,406  | 生活必需品      |
| SMITH (A.O.) CORP            | —     | 3     | 14       | 1,648  | 資本財・サービス   |
| DEERE & CO                   | 5     | 8     | 84       | 9,758  | 資本財・サービス   |
| QUANTA SERVICES INC          | 2     | —     | —        | —      | 資本財・サービス   |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | —     | 5.5   | 43       | 5,088  | 情報技術       |
| TIME WARNER INC              | 12.66 | 25.16 | 235      | 27,293 | 一般消費財・サービス |
| VMWARE INC-CLASS A           | 2     | 2     | 16       | 1,868  | 情報技術       |
| BAXALTA INC                  | 8     | —     | —        | —      | その他        |
| TEGNA INC                    | —     | 11.5  | 24       | 2,892  | 一般消費財・サービス |
| NASDAQ INC                   | 1     | 5     | 33       | 3,929  | 金融         |
| TARGA RESOURCES CORP         | —     | 6     | 35       | 4,077  | エネルギー      |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | —     | 2.5   | 30       | 3,557  | 金融         |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 5     | 11    | 80       | 9,280  | 公益事業       |
| MEDNAX INC                   | —     | 3     | 20       | 2,388  | ヘルスケア      |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 期首    | 期末    |          |         | 業種等        |
|------------------------------|-------|-------|----------|---------|------------|
|                              | 株数    | 株数    | 評価額      |         |            |
|                              |       |       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株    | 百株    | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP       | 1     | 5     | 38       | 4,451   | 一般消費財・サービス |
| TELEFLEX INC                 | —     | 2     | 32       | 3,825   | ヘルスケア      |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 2     | 2     | 19       | 2,246   | 資本財・サービス   |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR | —     | 3     | 24       | 2,843   | 資本財・サービス   |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 12.5  | 25.5  | 169      | 19,640  | 生活必需品      |
| AMETEK INC                   | 4.75  | 9.75  | 48       | 5,611   | 資本財・サービス   |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 2     | 9     | 39       | 4,623   | 生活必需品      |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 6     | 11.5  | 99       | 11,587  | 素材         |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 6     | 13.5  | 217      | 25,199  | 生活必需品      |
| SCANA CORP                   | —     | 3     | 21       | 2,467   | 公益事業       |
| KEURIG GREEN MOUNTAIN INC    | 1     | —     | —        | —       | その他        |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    | 1     | 1     | 14       | 1,663   | 金融         |
| WR GRACE & CO                | —     | 1.5   | 10       | 1,206   | 素材         |
| VALSPAR CORP/THE             | —     | 2     | 20       | 2,407   | 素材         |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 0.3   | 0.8   | 31       | 3,664   | 一般消費財・サービス |
| LEUCADIA NATIONAL CORP       | 4     | 14    | 32       | 3,769   | 金融         |
| UGI CORP                     | —     | 5     | 22       | 2,634   | 公益事業       |
| CUMMINS INC                  | 3     | 5     | 68       | 7,967   | 資本財・サービス   |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 8     | 19.5  | 73       | 8,524   | 情報技術       |
| SABRE CORP                   | —     | 5     | 12       | 1,443   | 情報技術       |
| CDW CORP/DE                  | —     | 3     | 15       | 1,780   | 情報技術       |
| SIGNATURE BANK               | —     | 1.5   | 22       | 2,609   | 金融         |
| COSTAR GROUP INC             | —     | 1.5   | 28       | 3,347   | 情報技術       |
| MERCADOLIBRE INC             | —     | 1.5   | 26       | 3,028   | 情報技術       |
| HANESBRANDS INC              | 6     | 17    | 37       | 4,380   | 一般消費財・サービス |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 7     | 5.83  | 33       | 3,850   | 一般消費財・サービス |
| DEXCOM INC                   | —     | 4     | 24       | 2,898   | ヘルスケア      |
| DIAMONDBACK ENERGY INC       | —     | 3     | 30       | 3,528   | エネルギー      |
| SEATTLE GENETICS INC         | —     | 4     | 23       | 2,727   | ヘルスケア      |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | —     | 3     | 28       | 3,297   | ヘルスケア      |
| TRANSIGM GROUP INC           | 1     | 2     | 51       | 5,921   | 資本財・サービス   |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 2     | 5     | 51       | 5,971   | 電気通信サービス   |
| NIELSEN HOLDINGS PLC         | 6     | 11.5  | 48       | 5,648   | 資本財・サービス   |
| KINDER MORGAN INC            | 26.96 | 58.96 | 127      | 14,795  | エネルギー      |
| HCA HOLDINGS INC             | 5     | 11    | 86       | 10,066  | ヘルスケア      |
| CABOT OIL & GAS CORP         | 8     | 18    | 39       | 4,610   | エネルギー      |
| T-MOBILE US INC              | 5     | 10.5  | 59       | 6,900   | 電気通信サービス   |
| COCA-COLA CO/THE             | 62    | 128.5 | 530      | 61,570  | 生活必需品      |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  | 5     | —     | —        | —       | 生活必需品      |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 3     | 7.5   | 39       | 4,612   | 資本財・サービス   |
| EATON VANCE CORP             | —     | 6     | 25       | 2,987   | 金融         |
| FMC TECHNOLOGIES INC         | 2     | 11    | 39       | 4,577   | エネルギー      |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 7     | 15    | 60       | 7,011   | 金融         |
| CSX CORP                     | 12    | 31    | 114      | 13,297  | 資本財・サービス   |
| FLUOR CORP                   | 3     | 3     | 15       | 1,823   | 資本財・サービス   |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 1     | 3.5   | 45       | 5,305   | ヘルスケア      |
| EXPEDIA INC                  | 2     | 4     | 46       | 5,440   | 一般消費財・サービス |
| AUTOLIV INC                  | 1.5   | 3.5   | 39       | 4,541   | 一般消費財・サービス |
| AMAZON.COM INC               | 6     | 12.7  | 1,012    | 117,361 | 一般消費財・サービス |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A   | —     | 7     | 25       | 2,902   | エネルギー      |
| FLOWSERVE CORP               | 3     | 3     | 14       | 1,687   | 資本財・サービス   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 4     | 7.5   | 73       | 8,518   | ヘルスケア      |

| 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      |            |
| EXXON MOBIL CORP             | 61.26 | 131.76 | 1,146    | 132,987 | エネルギー      |
| FLIR SYSTEMS INC             | 1     | 1      | 3        | 413     | 情報技術       |
| AES CORP                     | 17    | 17     | 19       | 2,272   | 公益事業       |
| L3 TECHNOLOGIES INC          | 1     | 2.5    | 38       | 4,431   | 資本財・サービス   |
| EVEREST RE GROUP LTD         | 1     | 1      | 21       | 2,515   | 金融         |
| EOG RESOURCES INC            | 7     | 19     | 195      | 22,697  | エネルギー      |
| EQT CORP                     | 3     | 6      | 37       | 4,395   | エネルギー      |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 3     | 7      | 49       | 5,682   | 情報技術       |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 4     | 7      | 59       | 6,938   | ヘルスケア      |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 4     | 9.5    | 45       | 5,303   | ヘルスケア      |
| FORD MOTOR CO                | 50    | 108.5  | 137      | 15,890  | 一般消費財・サービス |
| MACY'S INC                   | 6     | 12     | 36       | 4,238   | 一般消費財・サービス |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A   | 2     | 2      | 5        | 623     | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         | 5.16  | 5.16   | 17       | 2,021   | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY MEDIA CORP - A       | 2     | —      | —        | —       | その他        |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C   | 3     | 3      | 7        | 913     | 一般消費財・サービス |
| MOBILEYE NV                  | —     | 5      | 19       | 2,311   | 情報技術       |
| AERCAP HOLDINGS NV           | —     | 8.5    | 36       | 4,252   | 資本財・サービス   |
| FORTINET INC                 | —     | 3.5    | 10       | 1,270   | 情報技術       |
| MARKEL CORP                  | 0.25  | 0.5    | 45       | 5,223   | 金融         |
| NEXTERA ENERGY INC           | 6.5   | 14     | 165      | 19,213  | 公益事業       |
| FREEPORT-MCMORAN INC         | 13.5  | 38.5   | 56       | 6,553   | 素材         |
| US BANCORP                   | 26    | 54     | 275      | 31,979  | 金融         |
| UNITED RENTALS INC           | 2     | 2      | 21       | 2,462   | 資本財・サービス   |
| F5 NETWORKS INC              | 1     | 3      | 43       | 5,014   | 情報技術       |
| FASTENAL CO                  | 3     | 9.5    | 43       | 5,086   | 資本財・サービス   |
| FISERV INC                   | 4     | 6.5    | 70       | 8,147   | 情報技術       |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 135   | 281.5  | 885      | 102,694 | 資本財・サービス   |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 2     | 7.5    | 33       | 3,860   | 一般消費財・サービス |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO    | 3     | 11.5   | 36       | 4,245   | 一般消費財・サービス |
| GENERAL MOTORS CO            | 22    | 44     | 158      | 18,373  | 一般消費財・サービス |
| TRIPADVISOR INC              | 2     | 2      | 10       | 1,180   | 一般消費財・サービス |
| LINKEDIN CORP - A            | 2     | —      | —        | —       | 情報技術       |
| GENERAL DYNAMICS CORP        | 4     | 8.5    | 149      | 17,354  | 資本財・サービス   |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 6     | 11.5   | 279      | 32,390  | 金融         |
| GAMESTOP CORP-CLASS A        | 2     | —      | —        | —       | 一般消費財・サービス |
| ALPHABET INC-CL A            | 4.2   | 9.3    | 769      | 89,205  | 情報技術       |
| ALPHABET INC-CL C            | 4.61  | 9.71   | 783      | 90,826  | 情報技術       |
| GENERAL MILLS INC            | 10    | 19     | 115      | 13,342  | 生活必需品      |
| FIRSTENERGY CORP             | 5.67  | 13.17  | 40       | 4,735   | 公益事業       |
| GENUINE PARTS CO             | 3     | 5.5    | 52       | 6,125   | 一般消費財・サービス |
| IHS MARKIT LTD               | —     | 13.55  | 49       | 5,746   | 資本財・サービス   |
| FIFTH THIRD BANCORP          | 13    | 23.5   | 62       | 7,292   | 金融         |
| HARRIS CORP                  | 2     | 5      | 51       | 5,922   | 情報技術       |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC  | 3     | 3      | 14       | 1,637   | 資本財・サービス   |
| HALLIBURTON CO               | 14    | 25     | 140      | 16,254  | エネルギー      |
| HOME DEPOT INC               | 18.5  | 39.5   | 530      | 61,519  | 一般消費財・サービス |
| ASSURANT INC                 | —     | 2.5    | 23       | 2,728   | 金融         |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 12    | 36.5   | 48       | 5,637   | 金融         |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | —     | 2      | 38       | 4,416   | 資本財・サービス   |
| HERSHEY CO/THE               | 2     | 4.5    | 46       | 5,421   | 生活必需品      |
| HARLEY-DAVIDSON INC          | 4     | 4      | 23       | 2,697   | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                           | 期 首   | 期 末   |          |         | 業 種 等      |
|------------------------------|-------|-------|----------|---------|------------|
|                              | 株 数   | 株 数   | 評 価 額    |         |            |
|                              |       |       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株    | 百株    | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| HUMANA INC                   | 2     | 4.5   | 91       | 10,592  | ヘルスケア      |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS    | 2     | —     | —        | —       | その他        |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | —     | 10    | 98       | 11,376  | 情報技術       |
| HELMERICH & PAYNE            | 1     | 6     | 47       | 5,517   | エネルギー      |
| HENRY SCHEIN INC             | 2     | 2.5   | 39       | 4,558   | ヘルスケア      |
| HP INC                       | 26    | 58    | 85       | 9,873   | 情報技術       |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS    | 26    | 50    | 112      | 13,080  | 情報技術       |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | —     | 4     | 13       | 1,613   | 一般消費財・サービス |
| HOLLYFRONTIER CORP           | 2     | 2     | 6        | 717     | エネルギー      |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | —     | 2     | 7        | 817     | 一般消費財・サービス |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 2     | 5     | 42       | 4,941   | 金融         |
| HARMAN INTERNATIONAL         | —     | 1.5   | 16       | 1,923   | 一般消費財・サービス |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 8     | 18.5  | 159      | 18,464  | 生活必需品      |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 13.5  | 29    | 486      | 56,378  | 情報技術       |
| INTERNATIONAL PAPER CO       | 7     | 13.5  | 72       | 8,393   | 素材         |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 4     | 4     | 21       | 2,500   | 資本財・サービス   |
| ZOETIS INC                   | 8     | 16.5  | 89       | 10,322  | ヘルスケア      |
| INGERSOLL-RAND PLC           | 3.15  | 9.65  | 72       | 8,381   | 資本財・サービス   |
| CHENIERE ENERGY INC          | 5     | 5     | 21       | 2,541   | エネルギー      |
| LEGGETT & PLATT INC          | 2     | 2     | 9        | 1,111   | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C  | 10.86 | 18.86 | 61       | 7,151   | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C | —     | 1.35  | 2        | 345     | 一般消費財・サービス |
| WASTE CONNECTIONS INC        | —     | 7     | 56       | 6,578   | 資本財・サービス   |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 9     | 9     | 25       | 2,962   | 情報技術       |
| JM SMUCKER CO/THE            | 1     | 4     | 51       | 5,937   | 生活必需品      |
| JOHNSON & JOHNSON            | 41.5  | 86    | 1,000    | 115,960 | ヘルスケア      |
| ABBVIE INC                   | 24.66 | 51.66 | 331      | 38,464  | ヘルスケア      |
| HOLOGIC INC                  | 3     | 11    | 44       | 5,108   | ヘルスケア      |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 5     | 10.5  | 120      | 13,958  | 生活必需品      |
| KROGER CO                    | 12    | 30    | 98       | 11,452  | 生活必需品      |
| KLA-TENCOR CORP              | 1.5   | 5     | 39       | 4,614   | 情報技術       |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 4     | 8.2   | 211      | 24,514  | 資本財・サービス   |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC    | 1     | 3.3   | 48       | 5,658   | 情報技術       |
| L BRANDS INC                 | 3     | 8.5   | 52       | 6,042   | 一般消費財・サービス |
| LOWE'S COS INC               | 14    | 27.5  | 195      | 22,663  | 一般消費財・サービス |
| ELI LILLY & CO               | 14.5  | 31.5  | 240      | 27,859  | ヘルスケア      |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC   | 5     | 10    | 58       | 6,799   | 電気通信サービス   |
| LAM RESEARCH CORP            | 3     | 6     | 65       | 7,574   | 情報技術       |
| RANGE RESOURCES CORP         | 3     | 3     | 9        | 1,139   | エネルギー      |
| JONES LANG LASALLE INC       | —     | 1     | 10       | 1,236   | 不動産        |
| LOEWS CORP                   | 5     | 12    | 55       | 6,441   | 金融         |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 4     | 9     | 59       | 6,942   | 金融         |
| MCDONALD'S CORP              | 13.5  | 26    | 313      | 36,309  | 一般消費財・サービス |
| 3M CO                        | 9.5   | 19    | 336      | 39,056  | 資本財・サービス   |
| FACEBOOK INC-A               | 31.5  | 72.5  | 905      | 105,004 | 情報技術       |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V   | —     | 8.17  | 46       | 5,351   | 情報技術       |
| MANPOWERGROUP INC            | 1     | 1     | 8        | 1,041   | 資本財・サービス   |
| S&P GLOBAL INC               | 5     | 9     | 101      | 11,822  | 金融         |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 1     | 2.3   | 50       | 5,850   | 素材         |
| CONCHO RESOURCES INC         | 2     | 4     | 53       | 6,246   | エネルギー      |
| ENVISION HEALTHCARE CORP     | —     | 5.33  | 35       | 4,156   | ヘルスケア      |
| FIRST DATA CORP- CLASS A     | —     | 18.5  | 28       | 3,314   | 情報技術       |

| 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     |            |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC      | —     | 8      | 24           | 2,873  | 電気通信サービス   |
| PHILLIPS 66                  | 7.5   | 15.5   | 130          | 15,101 | エネルギー      |
| CONDUENT INC                 | —     | 7.51   | 10           | 1,212  | 情報技術       |
| HILTON GRAND VACATIONS-WI    | —     | 1.75   | 4            | 537    | 一般消費財・サービス |
| MURPHY OIL CORP              | 3     | 3      | 9            | 1,063  | エネルギー      |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 9     | 18     | 52           | 6,086  | 一般消費財・サービス |
| MATTEL INC                   | 6     | 14     | 42           | 4,954  | 一般消費財・サービス |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 2     | 4.5    | 40           | 4,703  | 生活必需品      |
| MYLAN NV                     | 7     | 12.5   | 48           | 5,645  | ヘルスケア      |
| METLIFE INC                  | 14    | 28     | 150          | 17,435 | 金融         |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 5     | 22     | 31           | 3,665  | 情報技術       |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 1.85  | 4.35   | 36           | 4,187  | 情報技術       |
| MONSANTO CO                  | 7     | 15     | 163          | 18,950 | 素材         |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 0.5   | 1      | 42           | 4,944  | ヘルスケア      |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 2     | 4      | 55           | 6,415  | 資本財・サービス   |
| MERCK & CO. INC.             | 42.37 | 87.87  | 536          | 62,257 | ヘルスケア      |
| MASCO CORP                   | 8     | 8      | 25           | 2,985  | 資本財・サービス   |
| M & T BANK CORP              | 2.32  | 4.32   | 67           | 7,812  | 金融         |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 9     | 16.5   | 111          | 12,972 | 金融         |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A  | 2.85  | 10.95  | 90           | 10,443 | 一般消費財・サービス |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 2     | 5      | 37           | 4,334  | 情報技術       |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD    | 4     | 4      | 16           | 1,949  | 一般消費財・サービス |
| VANTIV INC - CL A            | —     | 4      | 24           | 2,873  | 情報技術       |
| NETAPP INC                   | 3     | 10     | 35           | 4,085  | 情報技術       |
| NIKE INC -CL B               | 19    | 43.5   | 232          | 26,926 | 一般消費財・サービス |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 5     | 10     | 109          | 12,660 | 資本財・サービス   |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 5     | 5      | 32           | 3,735  | 情報技術       |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | —     | 3      | 22           | 2,562  | 金融         |
| ALLY FINANCIAL INC           | 6     | 19     | 37           | 4,351  | 金融         |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 2.5   | 5.5    | 129          | 15,039 | 資本財・サービス   |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC        | 5     | 9      | 61           | 7,103  | 一般消費財・サービス |
| NEWMONT MINING CORP          | 9     | 15.5   | 54           | 6,355  | 素材         |
| MCKESSON CORP                | 3.5   | 7      | 102          | 11,919 | ヘルスケア      |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 6     | 6      | 24           | 2,828  | 情報技術       |
| XYLEM INC                    | —     | 7.5    | 37           | 4,293  | 資本財・サービス   |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 23    | 49.5   | 451          | 52,412 | 生活必需品      |
| NUCOR CORP                   | 4     | 9      | 53           | 6,224  | 素材         |
| WESTERN UNION CO             | 10    | 10     | 22           | 2,614  | 情報技術       |
| NEWELL BRANDS INC            | 4     | 11.08  | 52           | 6,031  | 一般消費財・サービス |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 10.5  | 23     | 162          | 18,797 | エネルギー      |
| LIBERTY MEDIA CORP - C       | 4     | —      | —            | —      | その他        |
| LIBERTY BROADBAND-C          | —     | 2      | 15           | 1,741  | 一般消費財・サービス |
| PAYCHEX INC                  | 7     | 8.5    | 51           | 6,014  | 情報技術       |
| PATTERSON COS INC            | 3     | 3      | 12           | 1,479  | ヘルスケア      |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 1.5   | 3.5    | 97           | 11,339 | 一般消費財・サービス |
| ALTRIA GROUP INC             | 30    | 63     | 428          | 49,640 | 生活必需品      |
| P G & E CORP                 | 6     | 16.5   | 99           | 11,537 | 公益事業       |
| PFIZER INC                   | 91.58 | 192.08 | 642          | 74,549 | ヘルスケア      |
| ALKERMES PLC                 | 2     | 6      | 35           | 4,168  | ヘルスケア      |
| XCEL ENERGY INC              | 7     | 19     | 76           | 8,879  | 公益事業       |
| STRYKER CORP                 | 5     | 11     | 130          | 15,181 | ヘルスケア      |
| PARKER HANFIN CORP           | 2     | 4      | 56           | 6,529  | 資本財・サービス   |



外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 期 首   |       | 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     |            |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 2     | 5.5   | 100      | 11,645 | エネルギー      |
| POLARIS INDUSTRIES INC       | 1     | 1     | 8        | 970    | 一般消費財・サービス |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 40    | 80.7  | 681      | 78,981 | 生活必需品      |
| EXELON CORP                  | 12.04 | 28.04 | 98       | 11,468 | 公益事業       |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 3     | 8     | 115      | 13,430 | ヘルスケア      |
| CONOCOPHILLIPS               | 19    | 37.5  | 186      | 21,594 | エネルギー      |
| PEPSICO INC                  | 20.85 | 45.85 | 474      | 55,007 | 生活必需品      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 7     | 13    | 136      | 15,789 | 金融         |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 4     | 5.5   | 39       | 4,550  | 公益事業       |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 9.5   | 20    | 230      | 26,670 | 情報技術       |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD    | 2     | 2     | 13       | 1,507  | 金融         |
| PENTAIR PLC                  | 1.75  | 5.75  | 32       | 3,771  | 資本財・サービス   |
| QUALCOMM INC                 | 24    | 46.5  | 305      | 35,399 | 情報技術       |
| PARTNERRE LTD                | 1     | —     | —        | —      | その他        |
| INVESCO LTD                  | 8     | 16    | 49       | 5,723  | 金融         |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 1     | 3     | 50       | 5,897  | 一般消費財・サービス |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 4     | 8.5   | 49       | 5,735  | 金融         |
| ENERGEN CORP                 | 1     | —     | —        | —      | エネルギー      |
| RAYTHEON COMPANY             | 4.5   | 10    | 148      | 17,184 | 資本財・サービス   |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A  | 1     | 1     | 7        | 866    | 一般消費財・サービス |
| RED HAT INC                  | 4     | 7     | 50       | 5,855  | 情報技術       |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 1     | 2.6   | 92       | 10,704 | ヘルスケア      |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 6     | 7     | 39       | 4,579  | 資本財・サービス   |
| PRICELINE GROUP INC/THE      | 0.7   | 1.6   | 244      | 28,380 | 一般消費財・サービス |
| ROSS STORES INC              | 5     | 13.5  | 88       | 10,245 | 一般消費財・サービス |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | —     | 2.5   | 21       | 2,544  | 素材         |
| RESMED INC                   | —     | 6     | 37       | 4,401  | ヘルスケア      |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 2     | 6     | 55       | 6,430  | ヘルスケア      |
| ROBERT HALF INTL INC         | 3     | 3     | 14       | 1,681  | 資本財・サービス   |
| REYNOLDS AMERICAN INC        | 11.48 | 25.98 | 144      | 16,783 | 生活必需品      |
| RITE AID CORP                | 15    | 45    | 38       | 4,409  | 生活必需品      |
| RALPH LAUREN CORP            | 1     | 1     | 8        | 1,011  | 一般消費財・サービス |
| ROCKWELL COLLINS INC         | 1     | 3     | 27       | 3,192  | 資本財・サービス   |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 17    | 35.5  | 51       | 5,915  | 金融         |
| CHEVRON CORP                 | 27    | 59.5  | 689      | 79,925 | エネルギー      |
| EDISON INTERNATIONAL         | 6     | 9     | 63       | 7,411  | 公益事業       |
| TESLA MOTORS INC             | 1     | 4.5   | 104      | 12,068 | 一般消費財・サービス |
| SYMANTEC CORP                | 10    | 20    | 49       | 5,795  | 情報技術       |
| ENDO INTERNATIONAL PLC       | 3     | 3     | 4        | 570    | ヘルスケア      |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 3.02  | 5.52  | 64       | 7,531  | 資本財・サービス   |
| SYNOPSIS INC                 | 4     | 4     | 24       | 2,786  | 情報技術       |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 1     | 6.53  | 193      | 22,433 | 一般消費財・サービス |
| CBRE GROUP INC - A           | 4     | 12    | 37       | 4,331  | 不動産        |
| TWITTER INC                  | 8     | 25    | 43       | 5,073  | 情報技術       |
| NAVIENT CORP                 | 12    | —     | —        | —      | 金融         |
| SANDISK CORP                 | 2     | —     | —        | —      | その他        |
| SOUTHERN CO/THE              | 12    | 29    | 140      | 16,319 | 公益事業       |
| SYSCO CORP                   | 10    | 15    | 83       | 9,684  | 生活必需品      |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 5     | 9     | 105      | 12,243 | 金融         |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO       | 7     | 7     | 6        | 791    | エネルギー      |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | —     | 4     | 20       | 2,374  | 金融         |
| STERICYCLE INC               | 2     | 2     | 15       | 1,828  | 資本財・サービス   |

| 銘柄                             | 期 首   |        | 当 期 末    |        | 業 種 等      |
|--------------------------------|-------|--------|----------|--------|------------|
|                                | 株 数   | 株 数    | 評 価 額    |        |            |
|                                |       |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |            |
|                                | 百株    | 百株     | 千アメリカ・ドル | 千円     |            |
| SCHLUMBERGER LTD               | 18.5  | 44.93  | 385      | 44,686 | エネルギー      |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING   | 4     | 4      | 16       | 1,892  | 資本財・サービス   |
| AT&T INC                       | 87.2  | 194.7  | 794      | 92,115 | 電気通信サービス   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO          | —     | 5      | 25       | 2,916  | 資本財・サービス   |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE        | 1     | 2.8    | 78       | 9,051  | 素材         |
| SEMPRA ENERGY                  | 3.5   | 8.5    | 86       | 9,992  | 公益事業       |
| TIFFANY & CO                   | 1.5   | 4.5    | 34       | 4,009  | 一般消費財・サービス |
| SEAGATE TECHNOLOGY             | 5     | 11     | 41       | 4,853  | 情報技術       |
| TEXAS INSTRUMENTS INC          | 16    | 33     | 245      | 28,447 | 情報技術       |
| SALESFORCE.COM INC             | 10    | 21     | 155      | 18,010 | 情報技術       |
| SIGNET JEWELERS LTD            | 1     | 1      | 8        | 998    | 一般消費財・サービス |
| WESTROCK CO                    | 3.12  | 7.12   | 37       | 4,309  | 素材         |
| TIME WARNER CABLE              | 4.57  | —      | —        | —      | その他        |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL | 7     | 27.53  | 117      | 13,599 | 資本財・サービス   |
| TESORO CORP                    | 2     | 4.5    | 36       | 4,262  | エネルギー      |
| UNION PACIFIC CORP             | 12.5  | 26.5   | 271      | 31,473 | 資本財・サービス   |
| MARATHON OIL CORP              | 11    | 24     | 41       | 4,842  | エネルギー      |
| MARATHON PETROLEUM CORP        | 9     | 18.5   | 91       | 10,610 | エネルギー      |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP       | 13    | 26     | 289      | 33,616 | 資本財・サービス   |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B     | 10    | 21.5   | 246      | 28,613 | 資本財・サービス   |
| UNUM GROUP                     | 6     | 6      | 26       | 3,088  | 金融         |
| SPRINT CORP                    | 4.14  | 41.14  | 35       | 4,150  | 電気通信サービス   |
| QUINTILES IMS HOLDINGS INC     | —     | 3.53   | 27       | 3,192  | ヘルスケア      |
| VOYA FINANCIAL INC             | 5     | 5      | 19       | 2,280  | 金融         |
| AMEREN CORPORATION             | 6     | 8      | 41       | 4,823  | 公益事業       |
| UNITEDHEALTH GROUP INC         | 14.5  | 30     | 485      | 56,339 | ヘルスケア      |
| VERISIGN INC                   | 3     | 1.5    | 12       | 1,423  | 情報技術       |
| VALERO ENERGY CORP             | 7     | 15     | 99       | 11,544 | エネルギー      |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGR   | 1     | 2.3    | 59       | 6,955  | 一般消費財・サービス |
| FNF GROUP                      | 4     | 11     | 37       | 4,361  | 金融         |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B    | 2     | 2      | 22       | 2,586  | ヘルスケア      |
| ANTHEM INC                     | 3.5   | 8      | 114      | 13,246 | ヘルスケア      |
| WALT DISNEY CO/THE             | 23.5  | 48.5   | 525      | 60,942 | 一般消費財・サービス |
| WELLS FARGO & CO               | 71.37 | 149.87 | 812      | 94,263 | 金融         |
| FOOT LOCKER INC                | 3     | 3      | 21       | 2,465  | 一般消費財・サービス |
| WASTE MANAGEMENT INC           | 6     | 12.5   | 87       | 10,114 | 資本財・サービス   |
| WILLIAMS COS INC               | 12    | 20     | 63       | 7,405  | エネルギー      |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY         | 2     | 5      | 37       | 4,369  | 一般消費財・サービス |
| WHITING PETROLEUM CORP         | 4     | —      | —        | —      | エネルギー      |
| WHIRLPOOL CORP                 | 1     | 2      | 36       | 4,211  | 一般消費財・サービス |
| WAL-MART STORES INC            | 24    | 48.5   | 333      | 38,642 | 生活必需品      |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC     | 3     | 7.5    | 80       | 9,305  | ヘルスケア      |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PL   | 17    | 17     | 9        | 1,159  | エネルギー      |
| WYNN RESORTS LTD               | 2     | 2      | 18       | 2,151  | 一般消費財・サービス |
| XEROX CORP                     | 10.09 | 37.59  | 26       | 3,038  | 情報技術       |
| WABTEC CORP                    | 2     | 2      | 16       | 1,949  | 資本財・サービス   |
| TJX COMPANIES INC              | 9     | 20.5   | 156      | 18,090 | 一般消費財・サービス |
| WATERS CORP                    | 2     | 2.5    | 34       | 4,034  | ヘルスケア      |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS    | —     | 3.5    | 24       | 2,892  | 資本財・サービス   |
| ALLERGAN PLC                   | 5.89  | 12.59  | 277      | 32,133 | ヘルスケア      |
| WHOLE FOODS MARKET INC         | 7     | 7      | 21       | 2,497  | 生活必需品      |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC   | 13    | 28.5   | 235      | 27,281 | 生活必需品      |



| 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     | 千円    | 千円     |            |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 2.13   | 4.13   | 52    | 6,034  | 金融         |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 4      | 9.95   | 71    | 8,291  | 情報技術       |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 5      | 8.5    | 49    | 5,714  | 公益事業       |
| WESTAR ENERGY INC            | —      | 4      | 21    | 2,520  | 公益事業       |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 9      | 15     | 65    | 7,569  | 公益事業       |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 28     | 59     | 482   | 55,930 | 情報技術       |
| PPL CORP                     | 11     | 18     | 61    | 7,142  | 公益事業       |
| PULTEGROUP INC               | —      | 7      | 12    | 1,504  | 一般消費財・サービス |
| PPG INDUSTRIES INC           | 4      | 9      | 86    | 10,055 | 素材         |
| NORTHERN TRUST CORP          | 3      | 6.5    | 57    | 6,710  | 金融         |
| PRECISION CASTPARTS CORP     | 2      | —      | —     | —      | その他        |
| NVIDIA CORP                  | 7      | 16     | 171   | 19,904 | 情報技術       |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 7.53   | 15.03  | 177   | 20,600 | 金融         |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A | 6      | 18     | 34    | 4,055  | 一般消費財・サービス |
| TERADATA CORP                | 3      | —      | —     | —      | 情報技術       |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 4      | 7.5    | 46    | 5,448  | 生活必需品      |
| NETFLIX INC                  | 6      | 13     | 170   | 19,740 | 一般消費財・サービス |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 6      | 12     | 176   | 20,523 | ヘルスケア      |
| NRG ENERGY INC               | 8      | —      | —     | —      | 公益事業       |
| TORCHMARK CORP               | 3.5    | 3.5    | 25    | 2,999  | 金融         |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 2      | 5      | 46    | 5,335  | 金融         |
| TEXTRON INC                  | 5      | 10     | 49    | 5,744  | 資本財・サービス   |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A   | 18     | 37.5   | 110   | 12,815 | 一般消費財・サービス |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B | 9      | 9      | 25    | 3,002  | 一般消費財・サービス |
| NEWS CORP - CLASS A          | 8      | 8      | 9     | 1,113  | 一般消費財・サービス |
| OGE ENERGY CORP              | —      | 5      | 16    | 1,921  | 公益事業       |
| OMNICOM GROUP                | 4      | 7.5    | 64    | 7,426  | 一般消費財・サービス |
| ORACLE CORP                  | 49     | 99     | 386   | 44,806 | 情報技術       |
| MASTERCARD INC - A           | 15     | 30     | 322   | 37,414 | 情報技術       |
| ONEOK INC                    | 5      | 5      | 28    | 3,332  | エネルギー      |
| CENTURYLINK INC              | 8.47   | 16.97  | 42    | 4,964  | 電気通信サービス   |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 2      | 3.5    | 65    | 7,561  | 資本財・サービス   |
| YUM! BRANDS INC              | 6      | 9.5    | 61    | 7,116  | 一般消費財・サービス |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 1      | 2.5    | 59    | 6,887  | 情報技術       |
| MOLSON COORS BREWING CO-B    | 2      | 6.5    | 63    | 7,407  | 生活必需品      |
| NOBLE ENERGY INC             | 5      | 10.5   | 39    | 4,553  | エネルギー      |
| BANK OF AMERICA CORP         | 157.13 | 322.63 | 727   | 84,364 | 金融         |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 2      | 5      | 45    | 5,277  | ヘルスケア      |
| NORDSTROM INC                | 2      | 2      | 9     | 1,044  | 一般消費財・サービス |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 14     | 25     | 189   | 21,991 | 金融         |
| ANALOG DEVICES INC           | 4      | 8      | 57    | 6,673  | 情報技術       |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 3      | 10     | 46    | 5,397  | 金融         |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 19.2   | 32.2   | 213   | 24,785 | 金融         |
| ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC  | —      | 1      | 11    | 1,285  | 素材         |
| ANADARKO PETROLEUM CORP      | 7      | 18     | 125   | 14,606 | エネルギー      |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 2      | 7      | 52    | 6,140  | 情報技術       |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 2      | 5.5    | 46    | 5,392  | 一般消費財・サービス |
| NEWFIELD EXPLORATION CO      | —      | 5      | 21    | 2,453  | エネルギー      |
| MALLINCKRODT PLC             | 2      | 2      | 10    | 1,241  | ヘルスケア      |
| AVERY DENNISON CORP          | —      | 3      | 21    | 2,524  | 素材         |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 9      | 19.5   | 110   | 12,793 | 情報技術       |
| EMERSON ELECTRIC CO          | 8      | 21     | 117   | 13,683 | 資本財・サービス   |

| 銘柄                           | 期首   | 期末    |          |        | 業種等        |
|------------------------------|------|-------|----------|--------|------------|
|                              | 株数   | 株数    | 評価額      |        |            |
|                              |      |       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株   | 百株    | 千アメリカ・ドル | 千円     |            |
| AON PLC                      | 4    | 8.5   | 96       | 11,177 | 金融         |
| AMGEN INC                    | 11   | 24    | 381      | 44,205 | ヘルスケア      |
| CORE LABORATORIES N.V.       | —    | 1     | 12       | 1,439  | エネルギー      |
| COACH INC                    | 5    | 12    | 41       | 4,868  | 一般消費財・サービス |
| EATON CORP PLC               | 7.62 | 15.12 | 101      | 11,726 | 資本財・サービス   |
| CELGENE CORP                 | 12   | 24.5  | 294      | 34,151 | ヘルスケア      |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 3    | 6     | 90       | 10,455 | 生活必需品      |
| APPLIED MATERIALS INC        | 18   | 33.5  | 109      | 12,733 | 情報技術       |
| CIT GROUP INC                | 2    | 9     | 38       | 4,490  | 金融         |
| CIMAREX ENERGY CO            | 1    | 2.5   | 34       | 4,040  | エネルギー      |
| CME GROUP INC                | 5    | 10    | 116      | 13,489 | 金融         |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 5.89 | 14.89 | 56       | 6,573  | エネルギー      |
| ECOLAB INC                   | 4    | 8.5   | 101      | 11,713 | 素材         |
| EQUIFAX INC                  | 2    | 4.5   | 53       | 6,253  | 資本財・サービス   |
| GAP INC/THE                  | 3    | 3     | 7        | 829    | 一般消費財・サービス |
| GILEAD SCIENCES INC          | 22   | 41.5  | 314      | 36,496 | ヘルスケア      |
| ST JUDE MEDICAL INC          | 4    | —     | —        | —      | ヘルスケア      |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC  | 2.76 | 4.76  | 43       | 4,997  | 生活必需品      |
| HORMEL FOODS CORP            | 3    | 6     | 21       | 2,475  | 生活必需品      |
| STATE STREET CORP            | 7    | 13    | 105      | 12,266 | 金融         |
| STAPLES INC                  | 8    | 8     | 7        | 847    | 一般消費財・サービス |
| SUNTRUST BANKS INC           | 8    | 13.5  | 74       | 8,647  | 金融         |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 20   | 35.5  | 145      | 16,927 | 金融         |
| IHS INC-CLASS A              | 1    | —     | —        | —      | その他        |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 8    | 13    | 60       | 6,960  | ヘルスケア      |
| B/E AEROSPACE INC            | —    | 2.5   | 15       | 1,769  | 資本財・サービス   |
| CAMPBELL SOUP CO             | 4    | 8     | 47       | 5,542  | 生活必需品      |
| CROWN HOLDINGS INC           | 3    | 3     | 15       | 1,839  | 素材         |
| CHUBB CORP                   | 3.5  | —     | —        | —      | その他        |
| CARDINAL HEALTH INC          | 4    | 9.5   | 71       | 8,235  | ヘルスケア      |
| FEDEX CORP                   | 4    | 8.5   | 161      | 18,696 | 資本財・サービス   |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 8    | 15    | 131      | 15,209 | 金融         |
| FMC CORP                     | 3    | 3     | 17       | 2,015  | 素材         |
| FLEX LTD                     | 10   | 10    | 14       | 1,661  | 情報技術       |
| CERNER CORP                  | 5    | 9.5   | 45       | 5,286  | ヘルスケア      |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 2    | 2     | 23       | 2,680  | 素材         |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 3    | 5.5   | 49       | 5,790  | 情報技術       |
| INTEL CORP                   | 68   | 148.5 | 543      | 63,042 | 情報技術       |
| CAMERON INTERNATIONAL CORP   | 2    | —     | —        | —      | その他        |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 7    | 17    | 39       | 4,634  | 一般消費財・サービス |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 6    | 10.5  | 50       | 5,852  | 金融         |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 4.5  | 10    | 122      | 14,179 | 資本財・サービス   |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 61   | 30    | 13       | 1,600  | 一般消費財・サービス |
| ILLUMINA INC                 | 2    | 5.5   | 77       | 9,027  | ヘルスケア      |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP       | 12   | —     | —        | —      | エネルギー      |
| SEALED AIR CORP              | 3    | 8.5   | 40       | 4,639  | 素材         |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 0.5  | 1.3   | 83       | 9,667  | ヘルスケア      |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | —    | 6     | 52       | 6,067  | 情報技術       |
| SNAP-ON INC                  | 1.5  | 1.5   | 26       | 3,026  | 資本財・サービス   |
| CALPINE CORP                 | —    | 12    | 14       | 1,646  | 公益事業       |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 5    | —     | —        | —      | その他        |
| CARMAX INC                   | 3    | 8     | 52       | 6,047  | 一般消費財・サービス |

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 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      |            |
| COMERICA INC                 | 3     | 7     | 48       | 5,644   | 金融         |
| INGREDION INC                | —     | 3     | 37       | 4,348   | 生活必需品      |
| DUKE ENERGY CORP             | 10.38 | 22.38 | 171      | 19,889  | 公益事業       |
| TARGET CORP                  | 8     | 17.5  | 125      | 14,495  | 一般消費財・サービス |
| DOVER CORP                   | 2     | 5.5   | 42       | 4,893   | 資本財・サービス   |
| WW GRAINGER INC              | 1     | 2.5   | 57       | 6,677   | 資本財・サービス   |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 2     | 2     | 11       | 1,315   | 資本財・サービス   |
| JOHNSON CONTROLS INC         | 10    | —     | —        | —       | その他        |
| CINTAS CORP                  | 1     | 3.5   | 40       | 4,686   | 資本財・サービス   |
| CA INC                       | 6     | 6     | 19       | 2,313   | 情報技術       |
| CONAGRA BRANDS INC           | 5     | 11    | 42       | 4,903   | 生活必需品      |
| CLOROX COMPANY               | 2     | 4.5   | 54       | 6,329   | 生活必需品      |
| ENTERGY CORP                 | 2     | 4.5   | 31       | 3,709   | 公益事業       |
| MICROSOFT CORP               | 110   | 232   | 1,453    | 168,518 | 情報技術       |
| INCYTE CORP                  | 3     | 6     | 71       | 8,246   | ヘルスケア      |
| CVS HEALTH CORP              | 16.5  | 33    | 269      | 31,263  | 生活必需品      |
| MEDTRONIC PLC                | 21.56 | 42.56 | 314      | 36,432  | ヘルスケア      |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 19    | 36    | 80       | 9,325   | 情報技術       |
| BLACKROCK INC                | 2     | 3.8   | 144      | 16,763  | 金融         |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 9     | 9     | 22       | 2,596   | 公益事業       |
| HASBRO INC                   | 3     | 3     | 24       | 2,873   | 一般消費財・サービス |
| KELLOGG CO                   | 4     | 7     | 50       | 5,854   | 生活必需品      |
| KEYCORP                      | 11    | 40    | 73       | 8,469   | 金融         |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 2     | 2     | 16       | 1,891   | 資本財・サービス   |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 25    | 52    | 232      | 26,947  | 生活必需品      |
| KOHL'S CORP                  | 3     | 7.5   | 30       | 3,562   | 一般消費財・サービス |
| COOPER COS INC/THE           | —     | 1     | 17       | 2,065   | ヘルスケア      |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP   | 8     | 23    | 36       | 4,205   | 金融         |
| APACHE CORP                  | 6     | 14    | 87       | 10,123  | エネルギー      |
| CHUBB LTD                    | 4     | 14.1  | 184      | 21,338  | 金融         |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 1     | 4.5   | 32       | 3,772   | 情報技術       |
| ALLSTATE CORP                | 5     | 12.5  | 91       | 10,594  | 金融         |
| EBAY INC                     | 16.5  | 34    | 104      | 12,123  | 情報技術       |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 16.5  | 34    | 140      | 16,322  | 情報技術       |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 2     | 6     | 45       | 5,330   | 素材         |
| XILINX INC                   | 3     | 8     | 47       | 5,478   | 情報技術       |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO   | 10.35 | 21.35 | 152      | 17,716  | ヘルスケア      |
| DISH NETWORK CORP-A          | 3     | 6.5   | 40       | 4,646   | 一般消費財・サービス |
| YAHOO! INC                   | 11    | 28.5  | 117      | 13,662  | 情報技術       |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 3     | 5.5   | 43       | 4,989   | 生活必需品      |
| TOLL BROTHERS INC            | 4     | 4     | 12       | 1,443   | 一般消費財・サービス |
| TRIMBLE INC                  | —     | 5     | 15       | 1,753   | 情報技術       |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP       | 4     | 9     | 56       | 6,495   | 情報技術       |
| LENNAR CORP-A                | 3     | 8.5   | 37       | 4,292   | 一般消費財・サービス |
| LEAR CORP                    | 2     | 2     | 27       | 3,153   | 一般消費財・サービス |
| E*TRADE FINANCIAL CORP       | 7     | 7     | 25       | 2,959   | 金融         |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC    | 6     | —     | —        | —       | 資本財・サービス   |
| PROGRESSIVE CORP             | 8     | 15.5  | 55       | 6,420   | 金融         |
| PRAXAIR INC                  | 4     | 8     | 93       | 10,812  | 素材         |
| PACCAR INC                   | 6     | 11    | 71       | 8,300   | 資本財・サービス   |
| PVH CORP                     | 1     | 3.5   | 32       | 3,744   | 一般消費財・サービス |
| EMC CORP/MA                  | 26    | —     | —        | —       | その他        |

| 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                |            |
| BIOGEN INC                  | 3.5              | 6.5               | 194               | 22,538            | ヘルスケア      |
| IDEXX LABORATORIES INC      | —                | 2                 | 23                | 2,760             | ヘルスケア      |
| STARBUCKS CORP              | 21               | 46.5              | 270               | 31,382            | 一般消費財・サービス |
| PERRIGO CO PLC              | 2                | 5                 | 42                | 4,953             | ヘルスケア      |
| EVERSOURCE ENERGY           | 5                | 10                | 54                | 6,327             | 公益事業       |
| INTUIT INC                  | 4                | 8                 | 93                | 10,808            | 情報技術       |
| BORGWARNER INC              | 3                | 9                 | 36                | 4,260             | 一般消費財・サービス |
| BEST BUY CO INC             | 5                | 11                | 47                | 5,528             | 一般消費財・サービス |
| BALL CORP                   | 2                | 5.46              | 41                | 4,810             | 素材         |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP      | 23               | 45.5              | 100               | 11,707            | ヘルスケア      |
| BED BATH & BEYOND INC       | 3                | 3                 | 12                | 1,406             | 一般消費財・サービス |
| XL GROUP LTD                | 4                | 12                | 44                | 5,115             | 金融         |
| ELECTRONIC ARTS INC         | 4                | 10.5              | 82                | 9,575             | 情報技術       |
| VULCAN MATERIALS CO         | 1.5              | 3.5               | 42                | 4,980             | 素材         |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC  | 4                | 6.5               | 53                | 6,245             | ヘルスケア      |
| VF CORP                     | 6                | 11                | 58                | 6,751             | 一般消費財・サービス |
| CBS CORP-CLASS B NON VOTING | 6                | 14                | 88                | 10,305            | 一般消費財・サービス |
| VIACOM INC-CLASS B          | 6                | 14                | 53                | 6,224             | 一般消費財・サービス |
| MOHAWK INDUSTRIES INC       | 1                | 2.5               | 50                | 5,906             | 一般消費財・サービス |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC   | 5                | 5                 | 8                 | 928               | 情報技術       |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC  | 1                | 3                 | 26                | 3,115             | ヘルスケア      |
| CARNIVAL CORP               | 5                | 10                | 53                | 6,225             | 一般消費財・サービス |
| COMCAST CORP-CLASS A        | 38               | 75                | 531               | 61,600            | 一般消費財・サービス |
| JARDINE MATHESON HLDS LTD   | —                | 10                | 60                | 6,957             | 資本財・サービス   |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD  | —                | 20                | 13                | 1,590             | 不動産        |
| アメリカ・ドル<br>通 貨 計            | 株数・金額<br>総額数(比率) | 4,674.57<br>532銘柄 | 9,721.77<br>594銘柄 | -63.131<br><5.9%> | 7,320,709  |
| (カナダ)                       | 百株               | 百株                | 千カナダ・ドル           | 千円                |            |
| IMPERIAL OIL LTD            | 7                | 14                | 64                | 5,623             | エネルギー      |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC  | —                | 0.5               | 30                | 2,671             | 情報技術       |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD      | —                | 9.38              | 30                | 2,668             | エネルギー      |
| RESTAURANT BRANDS INTERN    | 3.21             | 8.21              | 53                | 4,708             | 一般消費財・サービス |
| SILVER WHEATON CORP         | 9                | 9                 | 24                | 2,113             | 素材         |
| INTACT FINANCIAL CORP       | 3                | 3                 | 28                | 2,506             | 金融         |
| BCE INC                     | 2                | 3                 | 17                | 1,524             | 電気通信サービス   |
| FRANCO-NEVADA CORP          | 3                | 7                 | 56                | 4,990             | 素材         |
| SUNCOR ENERGY INC           | 21.12            | 61.12             | 265               | 23,316            | エネルギー      |
| METRO INC                   | 6                | 6                 | 24                | 2,106             | 生活必需品      |
| NATIONAL BANK OF CANADA     | 4                | 10                | 55                | 4,824             | 金融         |
| BANK OF NOVA SCOTIA         | 18               | 43                | 328               | 28,798            | 金融         |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 7                | 14                | 155               | 13,672            | 金融         |
| TORONTO-DOMINION BANK       | 30               | 63                | 422               | 37,048            | 金融         |
| GREAT-WEST LIFE CO INC      | 6                | 7                 | 24                | 2,168             | 金融         |
| ROYAL BANK OF CANADA        | 23               | 51                | 471               | 41,390            | 金融         |
| TOURMALINE OIL CORP         | 3                | 13                | 42                | 3,691             | エネルギー      |
| VERMILION ENERGY INC        | 4                | 4                 | 22                | 1,971             | エネルギー      |
| TRANSNADANA CORP            | 12               | 27                | 164               | 14,438            | エネルギー      |
| PEMBINA PIPELINE CORP       | 9                | 18                | 75                | 6,589             | エネルギー      |
| BOMBARDIER INC-B            | 47               | 47                | 11                | 977               | 資本財・サービス   |
| BARRICK GOLD CORP           | 26               | 47                | 105               | 9,243             | 素材         |
| CAE INC                     | 7                | 7                 | 12                | 1,129             | 資本財・サービス   |
| THOMSON REUTERS CORP        | 3.2              | 14.2              | 83                | 7,344             | 金融         |

| 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    | 千カナダ・ドル | 千円     |            |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN   | 14    | 26    | 63      | 5,583  | 素材         |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B     | —     | 1     | 25      | 2,244  | 素材         |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP | —     | 19    | 23      | 2,070  | 金融         |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A  | —     | 11    | 29      | 2,611  | エネルギー      |
| HYDRO ONE LTD                 | —     | 15    | 35      | 3,102  | 公益事業       |
| LOBLAW COMPANIES LTD          | 4.89  | 9.89  | 69      | 6,081  | 生活必需品      |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A      | —     | 10    | 36      | 3,171  | 公益事業       |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B   | 8     | 15    | 77      | 6,763  | 電気通信サービス   |
| AGNICO EAGLE MINES LTD        | 2     | 6     | 34      | 3,068  | 素材         |
| KINROSS GOLD CORP             | 25.34 | 25.34 | 11      | 982    | 素材         |
| BANK OF MONTREAL              | 11    | 22    | 214     | 18,788 | 金融         |
| POWER CORP OF CANADA          | 5     | 16    | 48      | 4,238  | 金融         |
| METHANEX CORP                 | —     | 6     | 36      | 3,189  | 素材         |
| CAMECO CORP                   | 4     | 4     | 5       | 498    | エネルギー      |
| TELUS CORP                    | 3     | 3     | 13      | 1,156  | 電気通信サービス   |
| POWER FINANCIAL CORP          | 2     | 10    | 33      | 2,960  | 金融         |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B      | 6     | 17    | 46      | 4,097  | 素材         |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A    | 1     | 3     | 42      | 3,685  | 一般消費財・サービス |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD  | —     | 80    | 34      | 3,059  | 素材         |
| AGRIUM INC                    | 3     | 6     | 81      | 7,131  | 素材         |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES    | 19    | 41    | 171     | 15,040 | エネルギー      |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD   | 0.5   | 0.5   | 31      | 2,787  | 金融         |
| MAGNA INTERNATIONAL INC       | 7     | 12    | 70      | 6,169  | 一般消費財・サービス |
| WESTON (GEORGE) LTD           | —     | 2     | 22      | 1,979  | 生活必需品      |
| BLACKBERRY LTD                | —     | 27    | 25      | 2,233  | 情報技術       |
| SUN LIFE FINANCIAL INC        | 12    | 19    | 97      | 8,576  | 金融         |
| ENBRIDGE INC                  | 14    | 30    | 172     | 15,131 | エネルギー      |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A  | 16    | 31    | 135     | 11,845 | 金融         |
| MANULIFE FINANCIAL CORP       | 32    | 63    | 152     | 13,401 | 金融         |
| GOLDCORP INC                  | 12    | 26    | 49      | 4,363  | 素材         |
| ENCANA CORP                   | 15    | 44    | 74      | 6,495  | エネルギー      |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD  | 3     | 4     | 76      | 6,753  | 資本財・サービス   |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC  | 4     | 4     | 21      | 1,896  | 金融         |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC         | 4     | 4     | 13      | 1,172  | 一般消費財・サービス |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO      | 12    | 25    | 227     | 19,954 | 資本財・サービス   |
| CGI GROUP INC - CLASS A       | 3     | 7     | 45      | 3,990  | 情報技術       |
| HUSKY ENERGY INC              | 6.12  | 6.12  | 9       | 866    | エネルギー      |
| ONEX CORPORATION              | 3     | 3     | 26      | 2,340  | 金融         |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B     | 7     | 22    | 61      | 5,359  | 一般消費財・サービス |
| FINNING INTERNATIONAL INC     | 7     | 7     | 18      | 1,582  | 資本財・サービス   |
| SNC-LAVALIN GROUP INC         | 3     | 3     | 17      | 1,515  | 資本財・サービス   |
| ELDORADO GOLD CORP            | 3     | 3     | 1       | 116    | 素材         |
| IGM FINANCIAL INC             | 3     | 3     | 12      | 1,056  | 金融         |
| OPEN TEXT CORP                | 4     | 3     | 24      | 2,166  | 情報技術       |
| CI FINANCIAL CORP             | 6     | 6     | 17      | 1,494  | 金融         |
| SAPUTO INC                    | 6     | 6     | 28      | 2,466  | 生活必需品      |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD    | 9     | 33    | 47      | 4,174  | 素材         |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B    | 8     | 13    | 79      | 6,957  | 生活必需品      |
| YAMANA GOLD INC               | 42    | 52    | 21      | 1,911  | 素材         |
| FORTIS INC                    | 5     | 13    | 53      | 4,675  | 公益事業       |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP    | 8     | 25    | 42      | 3,754  | エネルギー      |
| CENOVUS ENERGY INC            | 12    | 25    | 49      | 4,348  | エネルギー      |
| DOLLARAMA INC                 | —     | 2     | 19      | 1,730  | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                                | 期 首            |                  | 当 期 末            |         | 業 種 等      |
|-----------------------------------|----------------|------------------|------------------|---------|------------|
|                                   | 株 数            | 株 数              | 評 価 額            |         |            |
|                                   |                |                  | 外貨建金額            | 邦貨換算金額  |            |
|                                   | 百株             | 百株               | 千カナダ・ドル          | 千円      |            |
| ALTAGAS LTD                       | —              | 8                | 27               | 2,425   | エネルギー      |
| KEYERA CORP                       | —              | 7                | 28               | 2,497   | エネルギー      |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP      | —              | 7                | 21               | 1,850   | エネルギー      |
| INTER PIPELINE LTD                | 8              | 8                | 23               | 2,062   | エネルギー      |
| CANADIAN OIL SANDS LTD            | 16             | —                | —                | —       | その他        |
| ARC RESOURCES LTD                 | 10             | 10               | 22               | 1,936   | エネルギー      |
| カナダ・ドル   株数・金額<br>通 貨 計   換算数<比率> | 662.38<br>68銘柄 | 1,396.26<br>82銘柄 | 5,575<br>< 4.0%> | 489,083 |            |
| (オーストラリア)                         | 百株             | 百株               | 千オーストラリア・ドル      | 千円      |            |
| MEDIBANK PRIVATE LTD              | —              | 93               | 26               | 2,257   | 金融         |
| BHP BILLITON LIMITED              | 56             | 116              | 295              | 25,160  | 素材         |
| SOUTH32 LTD                       | 91             | 225              | 62               | 5,307   | 素材         |
| LENDELEASE GROUP                  | 20             | 20               | 28               | 2,450   | 不動産        |
| ASCIANO LTD                       | 21.33          | —                | —                | —       | その他        |
| ALUMINA LTD                       | 121            | 121              | 21               | 1,844   | 素材         |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD            | 10             | 20               | 63               | 5,429   | エネルギー      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD        | 48             | 48               | 28               | 2,387   | 素材         |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK         | 8              | 8                | 10               | 895     | 金融         |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD       | 42             | 87               | 278              | 23,752  | 金融         |
| WESTPAC BANKING CORP              | 50.81          | 108.5            | 368              | 31,387  | 金融         |
| SANTOS LTD                        | 16             | 96               | 40               | 3,458   | エネルギー      |
| AUST AND NZ BANKING GROUP         | 47             | 97               | 308              | 26,243  | 金融         |
| RIO TINTO LTD                     | 7              | 12               | 71               | 6,065   | 素材         |
| ORIGIN ENERGY LTD                 | 20             | 68               | 46               | 3,926   | エネルギー      |
| AMCOR LIMITED                     | 25             | 51               | 77               | 6,575   | 素材         |
| AURIZON HOLDINGS LTD              | 22             | 85               | 44               | 3,800   | 資本財・サービス   |
| OIL SEARCH LTD                    | 32             | 32               | 23               | 2,030   | エネルギー      |
| SEEK LTD                          | —              | 26               | 39               | 3,376   | 資本財・サービス   |
| TREASURY WINE ESTATES LTD         | —              | 26               | 27               | 2,373   | 生活必需品      |
| NEWCREST MINING LTD               | 9              | 22               | 45               | 3,851   | 素材         |
| INCITEC PIVOT LTD                 | 73             | 73               | 26               | 2,281   | 素材         |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL      | 30             | 58               | 494              | 42,112  | 金融         |
| CALTEX AUSTRALIA LTD              | —              | 8                | 24               | 2,073   | エネルギー      |
| ORICA LTD                         | 2              | 20               | 36               | 3,079   | 素材         |
| QBE INSURANCE GROUP LTD           | 30             | 60               | 76               | 6,540   | 金融         |
| WOOLWORTHS LTD                    | 21             | 49               | 119              | 10,177  | 生活必需品      |
| COCA-COLA AMATIL LTD              | —              | 26               | 26               | 2,282   | 生活必需品      |
| TABCORP HOLDINGS LTD              | 24             | 24               | 11               | 1,005   | 一般消費財・サービス |
| TELSTRA CORP LTD                  | 74             | 136              | 71               | 6,115   | 電気通信サービス   |
| AMP LTD                           | 40.13          | 93.13            | 49               | 4,219   | 金融         |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI       | 12             | 12               | 26               | 2,229   | 素材         |
| MACQUARIE GROUP LTD               | 4.81           | 12.31            | 109              | 9,309   | 金融         |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD            | —              | 20               | 31               | 2,702   | 一般消費財・サービス |
| BANK OF QUEENSLAND LTD            | —              | 30               | 37               | 3,167   | 金融         |
| CSL LTD                           | 7              | 15.5             | 161              | 13,727  | ヘルスケア      |
| WESFARMERS LTD                    | 20.75          | 35.75            | 150              | 12,829  | 生活必需品      |
| COCHLEAR LTD                      | —              | 2                | 25               | 2,196   | ヘルスケア      |
| SUNCORP GROUP LTD                 | 19             | 39               | 53               | 4,589   | 金融         |
| BORAL LTD                         | 24             | 24               | 13               | 1,122   | 素材         |
| ASX LTD                           | 6              | 6                | 30               | 2,623   | 金融         |
| COMPUTERSHARE LTD                 | 9              | 9                | 11               | 959     | 情報技術       |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP         | 57             | 57               | 35               | 2,999   | 金融         |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 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               | 千円               |            |
| SONIC HEALTHCARE LTD         | 5                | 8                | 17               | 1,506            | ヘルスケア      |
| TRANSURBAN GROUP             | 23.22            | 80.22            | 84               | 7,200            | 資本財・サービス   |
| ILUKA RESOURCES LTD          | 7                | —                | —                | —                | 素材         |
| CHALLENGER LTD               | —                | 25               | 28               | 2,463            | 金融         |
| SYDNEY AIRPORT               | 46               | 38               | 23               | 1,964            | 資本財・サービス   |
| TATTS GROUP LTD              | —                | 80               | 35               | 3,058            | 一般消費財・サービス |
| AGL ENERGY LTD               | 9                | 25               | 55               | 4,764            | 公益事業       |
| BRAMBLES LTD                 | 24               | 45               | 57               | 4,855            | 資本財・サービス   |
| APA GROUP                    | —                | 31               | 27               | 2,360            | 公益事業       |
| DUET GROUP                   | —                | 100              | 27               | 2,375            | 公益事業       |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       | —                | 4                | 29               | 2,469            | ヘルスケア      |
| オーストラリア・ドル<br>通 貨 計          | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,214.05<br>41銘柄 | 2,607.41<br>52銘柄 | 3,921<br>333,940 | < 2.7%>    |
| (香港)                         | 百株               | 百株               | 千香港ドル            | 千円               |            |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 30               | 60               | 420              | 6,279            | 公益事業       |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 60               | 60               | 212              | 3,179            | 一般消費財・サービス |
| MTR CORP                     | 20               | 75               | 287              | 4,299            | 資本財・サービス   |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 30               | 50               | 520              | 7,774            | 不動産        |
| SINO LAND CO                 | 28               | 120              | 144              | 2,167            | 不動産        |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 40.52            | 100.52           | 904              | 13,524           | 資本財・サービス   |
| WHARF HOLDINGS LTD           | 40               | 40               | 224              | 3,354            | 不動産        |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 10               | 10               | 77               | 1,154            | 不動産        |
| CLP HOLDINGS LTD             | 25               | 70               | 516              | 7,717            | 公益事業       |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS       | 40               | 40               | 42               | 630              | 資本財・サービス   |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 33.55            | 36.9             | 155              | 2,319            | 不動産        |
| HONG KONG & CHINA GAS        | 158.65           | 324.51           | 455              | 6,811            | 公益事業       |
| HANG SENG BANK LTD           | 10               | 34               | 505              | 7,563            | 金融         |
| WHEELLOCK & CO LTD           | 20               | 20               | 91               | 1,364            | 不動産        |
| NEW WORLD DEVELOPMENT        | 90               | 90               | 76               | 1,143            | 不動産        |
| WH GROUP LTD                 | —                | 225              | 137              | 2,061            | 生活必需品      |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 17               | 38               | 705              | 10,543           | 金融         |
| LI & FUNG LTD                | 60               | 60               | 21               | 313              | 一般消費財・サービス |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD     | 20               | 120              | 207              | 3,096            | 不動産        |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG     | 10               | 10               | 27               | 404              | 一般消費財・サービス |
| BANK OF EAST ASIA LTD        | 20               | 20               | 62               | 935              | 金融         |
| SJM HOLDINGS LTD             | 100              | 100              | 60               | 905              | 一般消費財・サービス |
| SWIRE PROPERTIES LTD         | —                | 80               | 178              | 2,673            | 不動産        |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING | 40.52            | 105.52           | 526              | 7,863            | 不動産        |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE   | 20               | 20               | 123              | 1,840            | 公益事業       |
| AIA GROUP LTD                | 206              | 380              | 1,723            | 25,763           | 金融         |
| SANDS CHINA LTD              | 42               | 102              | 352              | 5,268            | 一般消費財・サービス |
| SHANGRI-LA ASIA LTD          | 40               | 40               | 32               | 490              | 一般消費財・サービス |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | —                | 55               | 152              | 2,281            | 一般消費財・サービス |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   | 70               | 155              | 444              | 6,638            | 金融         |
| WYNN MACAU LTD               | 60               | 60               | 78               | 1,169            | 一般消費財・サービス |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | —                | 130              | 120              | 1,805            | 電気通信サービス   |
| 香港ドル<br>通 貨 計                | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,341.24<br>28銘柄 | 2,831.45<br>32銘柄 | 9,588<br>143,343 | < 1.2%>    |
| (シンガポール)                     | 百株               | 百株               | 千シンガポール・ドル       | 千円               |            |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 21               | 53               | 110              | 8,961            | 金融         |

| 銘 柄                          | 期 首              |                | 期 末           |               | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|----------------|---------------|---------------|------------|
|                              | 株 数              | 株 数            | 評 価 額         |               |            |
|                              |                  |                | 外貨建金額         | 邦貨換算金額        |            |
|                              |                  | 百株             | 百株            | 千円            |            |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 30               | 68             | 121           | 9,806         | 金融         |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       | 20               | 20             | 19            | 1,588         | 資本財・サービス   |
| KEPPEL CORP LTD              | 28               | 28             | 16            | 1,370         | 資本財・サービス   |
| CITY DEVELOPMENTS LTD        | 10               | 10             | 8             | 688           | 不動産        |
| CAPITALAND LTD               | 70               | 70             | 21            | 1,747         | 不動産        |
| SEMBCORP MARINE LTD          | 20               | —              | —             | —             | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 30               | 120            | 43            | 3,509         | 一般消費財・サービス |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 40               | 105            | 96            | 7,804         | 金融         |
| GENTING SINGAPORE PLC        | —                | 450            | 42            | 3,453         | 一般消費財・サービス |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 120              | 277            | 103           | 8,392         | 電気通信サービス   |
| NOBLE GROUP LTD              | 38.18            | —              | —             | —             | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 40               | 40             | 13            | 1,066         | 資本財・サービス   |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD      | 40               | 40             | 12            | 992           | 資本財・サービス   |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD    | 90               | 90             | 3             | 312           | 生活必需品      |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 20               | 20             | 14            | 1,163         | 金融         |
| COMFORTDELGRO CORP LTD       | —                | 100            | 25            | 2,043         | 資本財・サービス   |
| STARHUB LTD                  | —                | 120            | 34            | 2,792         | 電気通信サービス   |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 50               | 50             | 18            | 1,470         | 生活必需品      |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 40               | 40             | 9             | 798           | 不動産        |
| シンガポール・ドル<br>通 貨 計           | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 707.18<br>17銘柄 | 1,701<br>18銘柄 | 717<br>57,962 | < 0.5%>    |
| (ニュージーランド)                   |                  | 百株             | 百株            | 千円            |            |
| MERIDIAN ENERGY LTD          | —                | 150            | 39            | 3,234         | 公益事業       |
| SPARK NEW ZEALAND LTD        | 112              | 56             | 20            | 1,665         | 電気通信サービス   |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | —                | 31             | 20            | 1,634         | 資本財・サービス   |
| FLETCHER BUILDING LTD        | 19               | 19             | 19            | 1,604         | 素材         |
| ニュージーランド・ドル<br>通 貨 計         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 131<br>2銘柄     | 256<br>4銘柄    | 100<br>8,138  | < 0.1%>    |
| (イギリス)                       |                  | 百株             | 百株            | 千円            |            |
| MERLIN ENTERTAINMENT         | —                | 50             | 22            | 3,232         | 一般消費財・サービス |
| TUI AG-DI                    | 6                | 26             | 30            | 4,309         | 一般消費財・サービス |
| BP PLC                       | 255              | 569            | 292           | 41,147        | エネルギー      |
| UNILEVER PLC                 | 18               | 44.2           | 147           | 20,818        | 生活必需品      |
| BARCLAYS PLC                 | 246              | 537.5          | 125           | 17,716        | 金融         |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     | 25               | 45.5           | 30            | 4,235         | 資本財・サービス   |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC    | 32               | 32             | 10            | 1,521         | 一般消費財・サービス |
| RANDGOLD RESOURCES LTD       | 2                | 2              | 13            | 1,875         | 素材         |
| REXAM PLC                    | 10.28            | —              | —             | —             | その他        |
| PRUDENTIAL PLC               | 39               | 77.5           | 124           | 17,462        | 金融         |
| INMARSAT PLC                 | 12               | 12             | 9             | 1,339         | 電気通信サービス   |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 51.7             | 151.7          | 34            | 4,858         | 金融         |
| JOHNSON MATTHEY PLC          | 3.3              | 3.3            | 10            | 1,481         | 素材         |
| BAE SYSTEMS PLC              | 49               | 85             | 50            | 7,152         | 資本財・サービス   |
| AVIVA PLC                    | 59.54            | 140.54         | 68            | 9,628         | 金融         |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          | 67               | 156.5          | 249           | 35,175        | ヘルスケア      |
| WORLDPAY GROUP PLC           | —                | 57             | 16            | 2,295         | 情報技術       |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | —                | 42             | 17            | 2,415         | 情報技術       |
| DCC PLC                      | —                | 1.5            | 9             | 1,310         | 資本財・サービス   |
| ROYAL MAIL PLC               | —                | 32.5           | 14            | 2,079         | 資本財・サービス   |
| RELX PLC                     | 21               | 37             | 53            | 7,581         | 資本財・サービス   |

| 銘柄                           | 期 首    | 当        | 期 末   |        | 業 種 等      |
|------------------------------|--------|----------|-------|--------|------------|
|                              | 株 数    | 株 数      | 評 価 額 |        |            |
|                              |        |          | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |            |
|                              | 百株     | 百株       | 千円    | 千円     |            |
| BG GROUP PLC                 | 50     | —        | —     | —      | その他        |
| DIAGEO PLC                   | 36     | 79.5     | 172   | 24,289 | 生活必需品      |
| RIO TINTO PLC                | 17     | 37.5     | 117   | 16,545 | 素材         |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 47     | 104      | 72    | 10,209 | 金融         |
| TESCO PLC                    | 142    | 237.5    | 47    | 6,721  | 生活必需品      |
| FRESNILLO PLC                | 8      | 8        | 10    | 1,543  | 素材         |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 11     | 24       | 29    | 4,123  | ヘルスケア      |
| GLENCORE PLC                 | 156    | 376.5    | 112   | 15,837 | 素材         |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | —      | 15       | 19    | 2,725  | 金融         |
| SMITHS GROUP PLC             | 9      | 9        | 13    | 1,837  | 資本財・サービス   |
| BABCOCK INTL GROUP PLC       | 6      | 6        | 5     | 782    | 資本財・サービス   |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  | —      | 47       | 17    | 2,435  | 金融         |
| DIXONS CARPHONE PLC          | —      | 47       | 16    | 2,254  | 一般消費財・サービス |
| PEARSON PLC                  | 15     | 15       | 12    | 1,729  | 一般消費財・サービス |
| SAINSBURY (J) PLC            | —      | 68.5     | 17    | 2,458  | 生活必需品      |
| NEXT PLC                     | 1.5    | 6        | 24    | 3,411  | 一般消費財・サービス |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 40     | 40       | 6     | 954    | 一般消費財・サービス |
| WHITBREAD PLC                | 4      | 4        | 15    | 2,177  | 一般消費財・サービス |
| IMI PLC                      | 4.75   | 4.75     | 5     | 712    | 資本財・サービス   |
| BUNZL PLC                    | 9      | 9        | 18    | 2,675  | 資本財・サービス   |
| GKN PLC                      | 26     | 26       | 8     | 1,210  | 一般消費財・サービス |
| VODAFONE GROUP PLC           | 362.45 | 778.45   | 161   | 22,797 | 電気通信サービス   |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      | 2      | 1.93     | 6     | 890    | 素材         |
| KINGFISHER PLC               | 39     | 97       | 33    | 4,745  | 一般消費財・サービス |
| WPP PLC                      | 16     | 40.5     | 75    | 10,637 | 一般消費財・サービス |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 14.4   | 14.4     | 12    | 1,821  | 公益事業       |
| SEVERN TRENT PLC             | 3      | 13       | 28    | 4,053  | 公益事業       |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 8      | 18.3     | 124   | 17,532 | 生活必需品      |
| ST JAMES'S PLACE PLC         | 6      | 27       | 28    | 4,019  | 金融         |
| SCHRODERS PLC                | —      | 5.5      | 16    | 2,348  | 金融         |
| TATE & LYLE PLC              | —      | 20       | 14    | 1,973  | 生活必需品      |
| AMEC FOSTER WHEELER PLC      | 13     | —        | —     | —      | エネルギー      |
| SSE PLC                      | 17     | 32       | 49    | 6,931  | 公益事業       |
| WEIR GROUP PLC/THE           | 2      | 13       | 25    | 3,604  | 資本財・サービス   |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 13     | 13       | 6     | 907    | 一般消費財・サービス |
| ASTRAZENECA PLC              | 18     | 39       | 179   | 25,306 | ヘルスケア      |
| WOLSELEY PLC                 | 3.23   | 6.73     | 33    | 4,735  | 資本財・サービス   |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 69     | 230.5    | 57    | 8,076  | 金融         |
| 3I GROUP PLC                 | 28     | 28       | 20    | 2,860  | 金融         |
| SKY PLC                      | 13     | 41       | 40    | 5,704  | 一般消費財・サービス |
| ASHTED GROUP PLC             | 12     | 12       | 18    | 2,675  | 資本財・サービス   |
| SAGE GROUP PLC/THE           | 23.79  | 23.79    | 15    | 2,248  | 情報技術       |
| NATIONAL GRID PLC            | 50     | 107.5    | 102   | 14,392 | 公益事業       |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 807.78 | 2,157.78 | 140   | 19,819 | 金融         |
| RSA INSURANCE GROUP PLC      | 23.8   | 23.8     | 13    | 1,925  | 金融         |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 13     | 29.5     | 106   | 15,024 | 生活必需品      |
| CENTRICA PLC                 | 78     | 168      | 38    | 5,451  | 公益事業       |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | —      | 7        | 20    | 2,829  | 一般消費財・サービス |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC      | —      | 5.5      | 15    | 2,240  | 金融         |
| ARM HOLDINGS PLC             | 20     | —        | —     | —      | その他        |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 26.55  | 57.55    | 269   | 37,889 | 生活必需品      |
| SABMILLER PLC                | 13     | —        | —     | —      | その他        |
| BHP BILLITON PLC             | 35     | 65       | 87    | 12,270 | 素材         |

| 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               | 千円               | 千円               |            |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 4                | 10.5             | 28               | 3,945            | 生活必需品      |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 280              | 620.5            | 415              | 58,451           | 金融         |
| SHIRE PLC                    | 8                | 26.22            | 128              | 18,047           | ヘルスケア      |
| OLD MUTUAL PLC               | 77.12            | 197.12           | 41               | 5,779            | 金融         |
| ANGLO AMERICAN PLC           | 20               | 54               | 62               | 8,779            | 素材         |
| MONDI PLC                    | 4                | 19               | 31               | 4,409            | 素材         |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     | 57               | 57               | 13               | 1,905            | 生活必需品      |
| CARNIVAL PLC                 | 4                | 4                | 16               | 2,390            | 一般消費財・サービス |
| COMPASS GROUP PLC            | 25.58            | 53.08            | 77               | 10,883           | 一般消費財・サービス |
| PERSIMMON PLC                | 4                | 16               | 31               | 4,369            | 一般消費財・サービス |
| BT GROUP PLC                 | 122              | 276              | 106              | 15,001           | 電気通信サービス   |
| BURBERRY GROUP PLC           | 7                | 21               | 31               | 4,439            | 一般消費財・サービス |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 3.53             | 2.94             | 10               | 1,532            | 一般消費財・サービス |
| AGGREKO PLC                  | 3.23             | —                | —                | —                | 資本財・サービス   |
| CAPITA PLC                   | 11               | 11               | 5                | 775              | 資本財・サービス   |
| TRAVIS PERKINS PLC           | 3                | 3                | 4                | 622              | 資本財・サービス   |
| INTERTEK GROUP PLC           | 3                | 3                | 10               | 1,469            | 資本財・サービス   |
| ITV PLC                      | 54               | 151.5            | 31               | 4,427            | 一般消費財・サービス |
| PETROFAC LTD                 | 9                | 9                | 8                | 1,175            | エネルギー      |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 6                | 13.5             | 39               | 5,562            | 金融         |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  | 59               | 133              | 299              | 42,237           | エネルギー      |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  | 34               | 120.27           | 281              | 39,701           | エネルギー      |
| MEGGITT PLC                  | —                | 35               | 15               | 2,208            | 資本財・サービス   |
| G4S PLC                      | 32               | 32               | 7                | 1,084            | 資本財・サービス   |
| COBHAM PLC                   | 34               | 34               | 5                | 788              | 資本財・サービス   |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 4                | 4                | 7                | 1,029            | 金融         |
| INVESTEC PLC                 | 9                | 9                | 4                | 687              | 金融         |
| ANTOFAGASTA PLC              | 7                | 7                | 4                | 694              | 素材         |
| STANDARD LIFE PLC            | 27.09            | 92.09            | 33               | 4,675            | 金融         |
| EXPERIAN PLC                 | 15               | 28               | 44               | 6,226            | 資本財・サービス   |
| イギリス・ボンド<br>通 貨 計            | 株数・金額<br>総額数<比率> | 4,135.62<br>90銘柄 | 9,386.44<br>98銘柄 | 5,618<br>< 6.4%> | 791,288    |
| (イスラエル)                      | 百株               | 百株               | 千イスラエル・<br>シユケル  | 千円               |            |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 50               | 50               | 35               | 1,057            | 電気通信サービス   |
| ELBIT SYSTEMS LTD            | —                | 3                | 118              | 3,575            | 資本財・サービス   |
| TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD  | 15               | —                | —                | —                | ヘルスケア      |
| BANK HAPOLALIM BM            | —                | 34               | 79               | 2,409            | 金融         |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 48               | 48               | 75               | 2,275            | 金融         |
| NICE LTD                     | 2                | 2                | 53               | 1,604            | 情報技術       |
| イスラエル・シユケル<br>通 貨 計          | 株数・金額<br>総額数<比率> | 115<br>4銘柄       | 137<br>5銘柄       | 362<br>< 0.1%>   | 10,923     |
| (スイス)                        | 百株               | 百株               | 千スイス・フラン         | 千円               |            |
| DUFREY AG-REG                | —                | 1.5              | 19               | 2,225            | 一般消費財・サービス |
| UBS GROUP AG-REG             | 62               | 125.5            | 210              | 24,113           | 金融         |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | —                | 0.5              | 26               | 2,993            | 素材         |
| ADECCO GROUP AG-REG          | 2                | 3.5              | 24               | 2,776            | 資本財・サービス   |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 11.2             | 24.1             | 582              | 66,675           | ヘルスケア      |
| SIKA AG-BR                   | 0.05             | 0.1              | 48               | 5,504            | 素材         |
| ABB LTD-REG                  | 34               | 68               | 148              | 16,993           | 資本財・サービス   |
| ARYZTA AG                    | 2                | 2                | 8                | 1,025            | 生活必需品      |
| TRANSOCEAN LTD               | 7                | —                | —                | —                | エネルギー      |
| SWISS RE AG                  | 6                | 11.5             | 110              | 12,633           | 金融         |



外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 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             | 千円             | 千円               |            |
| NESTLE SA-REG                | 51              | 106            | 791            | 90,560           | 生活必需品      |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | —               | 0.5            | 24             | 2,773            | 金融         |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 0.5             | 1.5            | 26             | 3,070            | 資本財・サービス   |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 27.31           | 72.31          | 115            | 13,157           | 金融         |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 5               | 5              | 23             | 2,699            | 金融         |
| SGS SA-REG                   | 0.07            | 0.17           | 35             | 4,110            | 資本財・サービス   |
| GALENICA AG-REG              | —               | 0.12           | 14             | 1,623            | ヘルスケア      |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 0.5             | 1              | 32             | 3,672            | 一般消費財・サービス |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 2.5             | 5.3            | 150            | 17,251           | 金融         |
| BALOISE HOLDING AG - REG     | 1               | 1              | 13             | 1,491            | 金融         |
| NOVARTIS AG-REG              | 36.5            | 75.3           | 564            | 64,590           | ヘルスケア      |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 9               | 16.5           | 112            | 12,870           | 一般消費財・サービス |
| SWISSCOM AG-REG              | 0.5             | 1.2            | 55             | 6,398            | 電気通信サービス   |
| GEBERIT AG-REG               | 0.5             | 1              | 40             | 4,685            | 資本財・サービス   |
| GIVAUDAN-REG                 | 0.2             | 0.35           | 65             | 7,465            | 素材         |
| ACTELION LTD-REG             | 2               | 4              | 91             | 10,416           | ヘルスケア      |
| SYNGENTA AG-REG              | 1.5             | 3.4            | 140            | 16,106           | 素材         |
| SONOVA HOLDING AG-REG        | 1               | 1              | 12             | 1,413            | ヘルスケア      |
| LONZA GROUP AG-REG           | 1               | 2.5            | 45             | 5,252            | ヘルスケア      |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG        | 7.2             | 16.7           | 89             | 10,247           | 素材         |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 0.5             | 1.5            | 44             | 5,096            | 金融         |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG   | 1               | 1              | 13             | 1,550            | 資本財・サービス   |
| SWISS PRIME SITE-REG         | 1               | 4.5            | 38             | 4,348            | 不動産        |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | —               | 0.03           | 16             | 1,892            | 生活必需品      |
| スイス・フラン<br>通 貨 計             | 株数、金額<br>総額<比率> | 274.03<br>29銘柄 | 558.58<br>33銘柄 | 7,739<br>< 3.5%> | 427,685    |
| (デンマーク)                      | 百株              | 百株             | 千円             | 千円               |            |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 32              | 67.5           | 1,728          | 28,557           | ヘルスケア      |
| DANSKE BANK A/S              | 14              | 24             | 521            | 8,615            | 金融         |
| ISS A/S                      | —               | 6              | 143            | 2,366            | 資本財・サービス   |
| AP MOELLER-MAERSK A/S-A      | 0.1             | 0.1            | 113            | 1,879            | 資本財・サービス   |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 3               | 6              | 283            | 4,676            | 資本財・サービス   |
| TDC A/S                      | 13              | 13             | 47             | 782              | 電気通信サービス   |
| CARLSBERG AS-B               | 2               | 5.5            | 338            | 5,587            | 生活必需品      |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES       | 5               | 5              | 126            | 2,090            | 素材         |
| COLOPLAST-B                  | 2               | 6.5            | 315            | 5,219            | ヘルスケア      |
| DSV A/S                      | 6               | 6              | 192            | 3,171            | 資本財・サービス   |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       | 0.1             | 0.26           | 311            | 5,145            | 資本財・サービス   |
| PANDORA A/S                  | 1.5             | 3              | 262            | 4,329            | 一般消費財・サービス |
| CHR HANSEN HOLDING A/S       | —               | 3.5            | 138            | 2,291            | 素材         |
| GENMAB A/S                   | —               | 1.5            | 193            | 3,196            | ヘルスケア      |
| DONG ENERGY A/S              | —               | 8              | 208            | 3,445            | 公益事業       |
| デンマーク・クローネ<br>通 貨 計          | 株数、金額<br>総額<比率> | 78.7<br>11銘柄   | 155.86<br>15銘柄 | 4,924<br>< 0.7%> | 81,357     |
| (ノルウェー)                      | 百株              | 百株             | 千円             | 千円               |            |
| NORSK HYDRO ASA              | 27              | 27             | 112            | 1,526            | 素材         |
| DNB ASA                      | 16              | 30             | 398            | 5,414            | 金融         |
| ORKLA ASA                    | 12              | 42             | 325            | 4,423            | 生活必需品      |
| TELENOR ASA                  | 13              | 29             | 391            | 5,320            | 電気通信サービス   |
| STATOIL ASA                  | 18              | 43.5           | 691            | 9,386            | エネルギー      |

| 銘 柄                          | 期 首              |             | 期 末               |                   | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|-------------|-------------------|-------------------|------------|
|                              | 株 数              | 株 数         | 評 価 額             |                   |            |
|                              |                  |             | 外貨建金額             | 邦貨換算金額            |            |
|                              | 百株               | 百株          | 千/ルーエー・<br>クローネ   | 千円                |            |
| YARA INTERNATIONAL ASA       | 2                | 8.5         | 299               | 4,063             | 素材         |
| MARINE HARVEST               | —                | 8.5         | 123               | 1,679             | 生活必需品      |
| SCHIBSTED ASA-B SHS          | 5                | 5           | 94                | 1,279             | 一般消費財・サービス |
| ノルウェー・クローネ<br>通 貨 計          | 株数、金額<br>総額数<比率> | 93<br>7銘柄   | 193.5<br>8銘柄      | 2,436<br>< 0.3%>  | 33,094     |
| (スウェーデン)                     | 百株               | 百株          | 千/スウェーデン・<br>クローネ | 千円                |            |
| ERICSSON LM-B SHS            | 47               | 81          | 433               | 5,565             | 情報技術       |
| VOLVO AB-B SHS               | 22               | 63          | 686               | 8,802             | 資本財・サービス   |
| MILICOM INTL CELLULAR-SDR    | 2                | 2           | 83                | 1,076             | 電気通信サービス   |
| SKF AB-B SHARES              | 7                | 7           | 118               | 1,515             | 資本財・サービス   |
| ELECTROLUX AB-SER B          | 3                | 15          | 330               | 4,245             | 一般消費財・サービス |
| NORDEA BANK AB               | 55               | 102         | 1,015             | 13,034            | 金融         |
| SWEDISH MATCH AB             | 3                | 3           | 87                | 1,119             | 生活必需品      |
| TELE2 AB-B SHS               | 3                | 3           | 21                | 282               | 電気通信サービス   |
| GETINGE AB-B SHS             | 2                | 2           | 29                | 380               | ヘルスケア      |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 26               | 49          | 466               | 5,988             | 金融         |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 20               | 60          | 738               | 9,468             | 金融         |
| SWEDBANK AB - A SHARES       | 15               | 34          | 731               | 9,383             | 金融         |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 14               | 35          | 861               | 11,055            | 一般消費財・サービス |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B   | 11               | 18          | 457               | 5,865             | 生活必需品      |
| SKANSKA AB-B SHS             | 6                | 18          | 382               | 4,912             | 資本財・サービス   |
| SANDVIK AB                   | 20               | 45          | 513               | 6,581             | 資本財・サービス   |
| INVESTOR AB-B SHS            | 6                | 12          | 409               | 5,259             | 金融         |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         | 8                | 24          | 679               | 8,720             | 資本財・サービス   |
| SECURITAS AB-B SHS           | 5                | 5           | 72                | 929               | 資本財・サービス   |
| TELIA CO AB                  | 36               | 84          | 312               | 4,014             | 電気通信サービス   |
| ALFA LAVAL AB                | 4                | 4           | 61                | 786               | 資本財・サービス   |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         | 5                | 16          | 405               | 5,205             | 資本財・サービス   |
| ASSA ABLOY AB-B              | 18               | 41          | 681               | 8,742             | 資本財・サービス   |
| LUNDIN PETROLEUM AB          | 8                | 8           | 153               | 1,973             | エネルギー      |
| BOLIDEN AB                   | 8                | 8           | 191               | 2,458             | 素材         |
| HUSQVARNA AB-B SHS           | —                | 24          | 168               | 2,161             | 一般消費財・サービス |
| KINNEVIK AB - B              | 5                | 5           | 111               | 1,425             | 金融         |
| HEXAGON AB-B SHS             | 4                | 10          | 342               | 4,398             | 情報技術       |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | —                | 13          | 215               | 2,760             | 金融         |
| スウェーデン・クローネ<br>通 貨 計         | 株数、金額<br>総額数<比率> | 363<br>27銘柄 | 791<br>29銘柄       | 10,764<br>< 1.1%> | 138,113    |
| ユーロ (アイルランド)                 | 百株               | 百株          | 千ユーロ              | 千円                |            |
| BANK OF IRELAND              | 270              | 1,570       | 39                | 4,799             | 金融         |
| KERRY GROUP PLC-A            | 3                | 5.5         | 38                | 4,679             | 生活必需品      |
| CRH PLC                      | 14               | 26.5        | 84                | 10,428            | 素材         |
| PADDY POWER BETFAIR PLC      | —                | 2           | 20                | 2,509             | 一般消費財・サービス |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>総額数<比率> | 287<br>3銘柄  | 1,604<br>4銘柄      | 182<br>< 0.2%>    | 22,416     |
| ユーロ (オランダ)                   | 百株               | 百株          | 千ユーロ              | 千円                |            |
| QIAGEN N.V.                  | 4                | 4           | 10                | 1,333             | ヘルスケア      |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 11               | 32.5        | 93                | 11,446            | 資本財・サービス   |
| NN GROUP NV                  | —                | 7           | 22                | 2,820             | 金融         |
| UNILEVER NV-CVA              | 24               | 47          | 183               | 22,537            | 生活必需品      |
| HEINEKEN NV                  | 3                | 8.6         | 61                | 7,524             | 生活必需品      |

| 銘柄                            | 株数               | 株数             | 期末             |                             | 業種等        |
|-------------------------------|------------------|----------------|----------------|-----------------------------|------------|
|                               |                  |                | 評価額            | 金額                          |            |
|                               |                  |                |                |                             |            |
|                               | 株数               | 株数             | 千ユーロ           | 千円                          |            |
| RELX NV                       | 18.45            | 32.45          | 51             | 6,310                       | 資本財・サービス   |
| AEGON NV                      | 26               | 86             | 44             | 5,456                       | 金融         |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 18.23            | 37.24          | 73             | 9,018                       | 生活必需品      |
| AKZO NOBEL                    | 5                | 10             | 59             | 7,338                       | 素材         |
| KONINKLIJKE DSM NV            | 3                | 6              | 35             | 4,318                       | 素材         |
| WOLTERS KLUWER                | 9                | 9.5            | 33             | 4,061                       | 資本財・サービス   |
| BOSKALIS WESTMINSTER          | 1                | 1              | 3              | 406                         | 資本財・サービス   |
| ING GROEP NV                  | 56               | 115            | 157            | 19,351                      | 金融         |
| KONINKLIJKE KPN NV            | 56               | 56             | 15             | 1,956                       | 電気通信サービス   |
| ASML HOLDING NV               | 5.5              | 12.4           | 131            | 16,191                      | 情報技術       |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA         | —                | 13             | 28             | 3,509                       | 金融         |
| RANDSTAD HOLDING NV           | 3                | 3              | 16             | 1,993                       | 資本財・サービス   |
| HEINEKEN HOLDING NV           | 2                | 2              | 13             | 1,627                       | 生活必需品      |
| GEMALTO                       | 2                | 2              | 11             | 1,356                       | 情報技術       |
| ALTICE NV - A                 | 3                | 13.5           | 25             | 3,117                       | 一般消費財・サービス |
| ALTICE NV - B                 | 1                | 1              | 1              | 231                         | 一般消費財・サービス |
| AIRBUS SE                     | 9                | 17.5           | 114            | 14,026                      | 資本財・サービス   |
| EXOR NV                       | —                | 4.5            | 19             | 2,371                       | 金融         |
| CNH INDUSTRIAL NV             | 14               | 46.5           | 38             | 4,730                       | 資本財・サービス   |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV  | 10               | 42             | 42             | 5,177                       | 一般消費財・サービス |
| FERRARI NV                    | 1                | 4.5            | 24             | 3,041                       | 一般消費財・サービス |
| 国小計                           | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 285.18<br>23銘柄 | 614.19<br>26銘柄 | 1,313<br>161,257<br>< 1.3%> |            |
| ユーロ (ベルギー)                    | 株数               | 株数             | 千ユーロ           | 千円                          |            |
| UCB SA                        | 3                | 3              | 19             | 2,418                       | ヘルスケア      |
| KBC GROEP NV                  | 5                | 9.5            | 56             | 6,985                       | 金融         |
| COLRUYT SA                    | —                | 3.5            | 16             | 2,002                       | 生活必需品      |
| DELHAIZE GROUP                | 1.5              | —              | —              | —                           | その他        |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA   | 1                | 4              | 31             | 3,887                       | 金融         |
| SOLVAY SA                     | 1                | 3              | 33             | 4,055                       | 素材         |
| UMICORE                       | 2                | 2              | 10             | 1,337                       | 素材         |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV    | 11.5             | 24.2           | 242            | 29,727                      | 生活必需品      |
| AGEAS                         | 3                | 3              | 11             | 1,414                       | 金融         |
| PROXIMUS                      | —                | 7              | 19             | 2,389                       | 電気通信サービス   |
| 国小計                           | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 28<br>8銘柄      | 59.2<br>9銘柄    | 441<br>54,219<br>< 0.4%>    |            |
| ユーロ (ルクセンブルグ)                 | 株数               | 株数             | 千ユーロ           | 千円                          |            |
| ARCELOMITTAL                  | 12               | 56             | 40             | 4,966                       | 素材         |
| EUROFINS SCIENTIFIC           | —                | 0.6            | 25             | 3,084                       | ヘルスケア      |
| SES                           | 6                | 19             | 40             | 4,914                       | 一般消費財・サービス |
| TENARIS SA                    | 6                | 22             | 37             | 4,570                       | エネルギー      |
| 国小計                           | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 24<br>3銘柄      | 97.6<br>4銘柄    | 142<br>17,535<br>< 0.1%>    |            |
| ユーロ (フランス)                    | 株数               | 株数             | 千ユーロ           | 千円                          |            |
| TOTAL SA                      | 32               | 67.5           | 324            | 39,851                      | エネルギー      |
| MICHELIN (CGDE)               | 2                | 6.5            | 68             | 8,439                       | 一般消費財・サービス |
| AIR LIQUIDE SA                | 5.15             | 12.79          | 133            | 16,441                      | 素材         |
| KERING                        | 1                | 3.2            | 69             | 8,500                       | 一般消費財・サービス |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE         | 8                | 19             | 126            | 15,499                      | 資本財・サービス   |
| BOUYGUES SA                   | 5                | 5              | 16             | 2,082                       | 資本財・サービス   |
| BNP PARIBAS                   | 16.5             | 34.5           | 211            | 25,919                      | 金融         |
| PEUGEOT SA                    | 11               | 11             | 18             | 2,237                       | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                           |                  | 期 首            |                | 当 期 末                       |        | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|----------------|----------------|-----------------------------|--------|------------|
|                              |                  | 株 数            | 株 数            | 評 価 額                       |        |            |
|                              |                  |                |                | 外貨建金額                       | 邦貨換算金額 |            |
|                              |                  | 百株             | 百株             | 千ユーロ                        | 千円     |            |
| NATIXIS                      |                  | 30             | 30             | 16                          | 2,006  | 金融         |
| THALES SA                    |                  | 1              | 3              | 27                          | 3,315  | 資本財・サービス   |
| DANONE                       |                  | 8              | 18.5           | 113                         | 13,967 | 生活必需品      |
| CARREFOUR SA                 |                  | 11             | 22             | 50                          | 6,165  | 生活必需品      |
| SUEZ                         |                  | 1.5            | 9.5            | 13                          | 1,621  | 公益事業       |
| VIVENDI                      |                  | 17.96          | 27.46          | 50                          | 6,161  | 一般消費財・サービス |
| L'OREAL                      |                  | 4              | 7.9            | 135                         | 16,620 | 生活必需品      |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN    |                  | 7              | 16.5           | 74                          | 9,091  | 資本財・サービス   |
| LEGRAND SA                   |                  | 4              | 8.5            | 45                          | 5,612  | 資本財・サービス   |
| ALCATEL-LUCENT SA            |                  | 40             | —              | —                           | —      | その他        |
| CASINO GUICHARD PERRACHON    |                  | 2              | 2              | 9                           | 1,183  | 生活必需品      |
| PERNOD RICARD SA             |                  | 3.6            | 8.1            | 85                          | 10,447 | 生活必需品      |
| SOCIETE BIC SA               |                  | —              | 1.5            | 19                          | 2,365  | 資本財・サービス   |
| EURAZEO                      |                  | —              | 5              | 28                          | 3,456  | 金融         |
| REXEL SA                     |                  | —              | 16             | 25                          | 3,189  | 資本財・サービス   |
| SOCIETE GENERALE SA          |                  | 11             | 23.5           | 108                         | 13,331 | 金融         |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI |                  | 4              | 9.3            | 168                         | 20,661 | 一般消費財・サービス |
| ACCOR SA                     |                  | 3              | 3              | 11                          | 1,402  | 一般消費財・サービス |
| CAPGEMINI                    |                  | 3              | 6              | 48                          | 5,950  | 情報技術       |
| VALEO SA                     |                  | 1              | 6.5            | 35                          | 4,358  | 一般消費財・サービス |
| PUBLICIS GROUPE              |                  | 2.5            | 5              | 33                          | 4,113  | 一般消費財・サービス |
| BUREAU VERITAS SA            |                  | 4              | 4              | 7                           | 931    | 資本財・サービス   |
| EIFFAGE                      |                  | —              | 4              | 27                          | 3,322  | 資本財・サービス   |
| SODEXO                       |                  | 2              | 2              | 21                          | 2,679  | 一般消費財・サービス |
| INGENICO GROUP               |                  | —              | 2              | 15                          | 1,899  | 情報技術       |
| ZODIAC AEROSPACE             |                  | —              | 8              | 18                          | 2,249  | 資本財・サービス   |
| ESSILOR INTERNATIONAL        |                  | 3              | 7              | 73                          | 9,045  | ヘルスケア      |
| AXA SA                       |                  | 28             | 57.5           | 141                         | 17,377 | 金融         |
| CHRISTIAN DIOR SE            |                  | 1              | 2.5            | 49                          | 6,057  | 一般消費財・サービス |
| TECHNIP SA                   |                  | 2              | 2              | 13                          | 1,679  | エネルギー      |
| EDENRED                      |                  | 8              | 8              | 15                          | 1,916  | 資本財・サービス   |
| RENAULT SA                   |                  | 3              | 6              | 51                          | 6,314  | 一般消費財・サービス |
| HERMES INTERNATIONAL         |                  | 0.32           | 0.82           | 32                          | 3,940  | 一般消費財・サービス |
| ATOS SE                      |                  | 2              | 2              | 20                          | 2,524  | 情報技術       |
| DASSAULT SYSTEMES SA         |                  | 2.5            | 6              | 44                          | 5,404  | 情報技術       |
| ORANGE                       |                  | 25             | 66.5           | 98                          | 12,067 | 電気通信サービス   |
| ALSTOM                       |                  | 3.1            | 3.1            | 8                           | 1,005  | 資本財・サービス   |
| SANOFI                       |                  | 17.5           | 36             | 279                         | 34,264 | ヘルスケア      |
| VINCI SA                     |                  | 6              | 17             | 112                         | 13,775 | 資本財・サービス   |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         |                  | 10             | 25             | 39                          | 4,812  | 公益事業       |
| CREDIT AGRICOLE SA           |                  | 12             | 38.5           | 46                          | 5,731  | 金融         |
| ENGIE                        |                  | 22.89          | 56.39          | 67                          | 8,342  | 公益事業       |
| SAFRAN SA                    |                  | 4.5            | 11.5           | 77                          | 9,546  | 資本財・サービス   |
| ILIAD SA                     |                  | —              | 1              | 18                          | 2,290  | 電気通信サービス   |
| ARKEMA                       |                  | 2              | 2              | 18                          | 2,265  | 素材         |
| ADP                          |                  | 1              | 1              | 10                          | 1,243  | 資本財・サービス   |
| SCOR SE                      |                  | 6              | 6              | 19                          | 2,376  | 金融         |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR  |                  | 11             | 11             | 10                          | 1,241  | 資本財・サービス   |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 412.02<br>49銘柄 | 775.56<br>55銘柄 | 3,406<br>418,303<br>< 3.4%> |        |            |
| ユーロ (ドイツ)                    |                  | 百株             | 百株             | 千ユーロ                        | 千円     |            |
| BAYER AG-REG                 |                  | 11.5           | 25             | 254                         | 31,216 | ヘルスケア      |



外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘 柄                                                      | 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             | 千ユーロ           | 千円                          |            |
| EVONIK INDUSTRIES AG                                     | －                | 6              | 16             | 2,027                       | 素材         |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED                              | 19               | 48.5           | 87             | 10,778                      | 金融         |
| COMMERZBANK AG                                           | 14.9             | 49.9           | 38             | 4,693                       | 金融         |
| VOLKSWAGEN AG                                            | 0.5              | 0.5            | 7              | 908                         | 一般消費財・サービス |
| VOLKSWAGEN AG-PREF                                       | 2.5              | 6              | 87             | 10,744                      | 一般消費財・サービス |
| MAN SE                                                   | 1                | 1              | 9              | 1,171                       | 資本財・サービス   |
| SIEMENS AG-REG                                           | 11               | 24             | 278            | 34,196                      | 資本財・サービス   |
| E.ON SE                                                  | 29.5             | 55.5           | 36             | 4,526                       | 公益事業       |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG                              | 5.5              | 11             | 98             | 12,132                      | 一般消費財・サービス |
| GEA GROUP AG                                             | 2                | 5.5            | 20             | 2,546                       | 資本財・サービス   |
| OSRAM LIGHT AG                                           | 1.45             | 1.45           | 7              | 887                         | 資本財・サービス   |
| CONTINENTAL AG                                           | 2                | 3.3            | 61             | 7,572                       | 一般消費財・サービス |
| BASF SE                                                  | 13.5             | 28.4           | 248            | 30,566                      | 素材         |
| LINDE AG                                                 | 3                | 7              | 108            | 13,338                      | 素材         |
| K+S AG-REG                                               | 3                | 3              | 6              | 827                         | 素材         |
| ALLIANZ SE-REG                                           | 7                | 14.6           | 234            | 28,735                      | 金融         |
| THYSSENKRUPP AG                                          | 5                | 15.5           | 34             | 4,280                       | 素材         |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG                               | 3                | 7              | 79             | 9,815                       | 生活必需品      |
| RWE AG                                                   | 4                | 16.5           | 19             | 2,390                       | 公益事業       |
| BRENNTAG AG                                              | 3                | 8              | 41             | 5,105                       | 資本財・サービス   |
| FRESENIUS SE & CO KGAA                                   | 5                | 11             | 79             | 9,782                       | ヘルスケア      |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE                             | －                | 4              | 15             | 1,890                       | 情報技術       |
| SAP SE                                                   | 13               | 28.5           | 240            | 29,512                      | 情報技術       |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG                               | 2                | 4.5            | 79             | 9,801                       | 金融         |
| HEIDELBERGCEMENT AG                                      | 3                | 6              | 51             | 6,328                       | 素材         |
| COVESTRO AG                                              | －                | 4              | 24             | 3,048                       | 素材         |
| INNOGY SE                                                | －                | 6              | 18             | 2,328                       | 公益事業       |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF                               | 3                | 8              | 44             | 5,417                       | 一般消費財・サービス |
| BEIERSDORF AG                                            | 2                | 5              | 40             | 4,958                       | 生活必需品      |
| MERCK KGAA                                               | 3                | 5.7            | 58             | 7,159                       | ヘルスケア      |
| ADIDAS AG                                                | 4                | 6.2            | 89             | 10,999                      | 一般消費財・サービス |
| HENKEL AG & CO KGAA                                      | 2                | 4              | 39             | 4,842                       | 生活必需品      |
| METRO AG                                                 | 5                | 5              | 15             | 1,918                       | 生活必需品      |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG                                  | 46               | 95             | 155            | 19,117                      | 電気通信サービス   |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 4.5              | 7.5            | 56             | 6,916                       | ヘルスケア      |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG                                 | 14               | 31.1           | 223            | 27,485                      | 一般消費財・サービス |
| HANNOVER RUECK SE                                        | 1                | 1              | 10             | 1,257                       | 金融         |
| DEUTSCHE POST AG-REG                                     | 11               | 27             | 85             | 10,480                      | 資本財・サービス   |
| DEUTSCHE BOERSE AG                                       | 4                | －              | －              | －                           | 金融         |
| DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER                                | －                | 7              | 54             | 6,699                       | 金融         |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE                                  | 3                | 9              | 34             | 4,230                       | 一般消費財・サービス |
| LANXESS AG                                               | 2                | 2              | 12             | 1,595                       | 素材         |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR                                    | 7                | 15.8           | 47             | 5,883                       | 不動産        |
| SYMRISE AG                                               | －                | 4              | 23             | 2,829                       | 素材         |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG                             | 1                | －              | －              | －                           | 一般消費財・サービス |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF                             | －                | 2.5            | 18             | 2,256                       | 一般消費財・サービス |
| HUGO BOSS AG -ORD                                        | －                | 3.5            | 19             | 2,435                       | 一般消費財・サービス |
| VONOVIA SE                                               | 6                | 11.5           | 35             | 4,380                       | 不動産        |
| 国 小 計                                                    | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 297.85<br>42銘柄 | 693.45<br>48銘柄 | 3,422<br>420,227<br>< 3.4%> |            |

| 銘 柄                          | 期 首              |                | 期 末              |                             | 業 種 等      |
|------------------------------|------------------|----------------|------------------|-----------------------------|------------|
|                              | 株 数              | 株 数            | 評 価 額            |                             |            |
|                              |                  |                | 外貨建金額            | 邦貨換算金額                      |            |
|                              | 百株               | 百株             | 千ユーロ             | 千円                          |            |
| ユーロ（ポルトガル）                   | 百株               | 百株             | 千ユーロ             | 千円                          |            |
| JERONIMO MARTINS             | 8                | 8              | 12               | 1,570                       | 生活必需品      |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA  | 57               | 57             | 15               | 1,955                       | 公益事業       |
| GALP ENERGIA SGPS SA         | —                | 18             | 25               | 3,132                       | エネルギー      |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 65<br>2銘柄      | 83<br>3銘柄        | 54<br>6,658<br>< 0.1%>      |            |
| ユーロ（スペイン）                    | 百株               | 百株             | 千ユーロ             | 千円                          |            |
| TELEFONICA SA                | 74               | 148            | 135              | 16,674                      | 電気通信サービス   |
| ENDESA SA                    | —                | 9              | 18               | 2,213                       | 公益事業       |
| BANCO POPULAR ESPANOL        | 32.41            | 32.41          | 3                | 397                         | 金融         |
| BANCO POPULAR ESPANOL-RTS    | 32.41            | —              | —                | —                           | その他        |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 93.9             | 197.89         | 129              | 15,882                      | 金融         |
| IBERDROLA SA                 | 77.35            | 156.06         | 94               | 11,548                      | 公益事業       |
| BANCO DE SABADELL SA         | 54.14            | 145.87         | 20               | 2,466                       | 金融         |
| BANKINTER SA                 | —                | 27             | 20               | 2,486                       | 金融         |
| REPSOL SA                    | 13               | 28             | 37               | 4,665                       | エネルギー      |
| GRIFOLS SA                   | 4                | 4              | 7                | 956                         | ヘルスケア      |
| BANCO SANTANDER SA           | 212              | 428.5          | 219              | 26,936                      | 金融         |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA  | 12               | 32.6           | 44               | 5,493                       | 資本財・サービス   |
| AMADEUS IT GROUP SA          | 9                | 14             | 61               | 7,514                       | 情報技術       |
| GAS NATURAL SDG SA           | 6                | 6              | 10               | 1,292                       | 公益事業       |
| CAIXABANK S.A                | 63               | 143.87         | 47               | 5,816                       | 金融         |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI | —                | 49             | 26               | 3,242                       | 資本財・サービス   |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV  | 3                | 3              | 9                | 1,106                       | 資本財・サービス   |
| AENA SA                      | —                | 2              | 26               | 3,253                       | 資本財・サービス   |
| IBERDROLA SA-RTS             | —                | 156.06         | 2                | 256                         | その他        |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL   | 14.5             | 37.5           | 119              | 14,671                      | 一般消費財・サービス |
| ENAGAS SA                    | 8                | 8              | 19               | 2,358                       | 公益事業       |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 2                | 23             | 39               | 4,878                       | 公益事業       |
| FERROVIAL SA                 | 9                | 26             | 47               | 5,773                       | 資本財・サービス   |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL  | —                | 32             | 15               | 1,862                       | 生活必需品      |
| BANKIA SA                    | 50               | 50             | 5                | 626                         | 金融         |
| 国 小 計                        | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 769.71<br>19銘柄 | 1,759.76<br>24銘柄 | 1,159<br>142,375<br>< 1.2%> |            |
| ユーロ（イタリア）                    | 百株               | 百株             | 千ユーロ             | 千円                          |            |
| BANCO POPOLARE SC            | 5                | —              | —                | —                           | その他        |
| PRYSMIAN SPA                 | 4                | 4              | 9                | 1,176                       | 資本財・サービス   |
| ASSICURAZIONI GENERALI       | 13.11            | 40.11          | 56               | 6,963                       | 金融         |
| MEDIOBANCA SPA               | 11.6             | 11.6           | 9                | 1,113                       | 金融         |
| UNICREDIT SPA                | 68.33            | 149.33         | 39               | 4,902                       | 金融         |
| TELECOM ITALIA SPA           | 148              | 298            | 24               | 3,007                       | 電気通信サービス   |
| TELECOM ITALIA-RSP           | 97               | 97             | 6                | 807                         | 電気通信サービス   |
| INTESA SANPAOLO              | 192              | 399.5          | 98               | 12,144                      | 金融         |
| ATLANTIA SPA                 | 6.77             | 14.77          | 33               | 4,060                       | 資本財・サービス   |
| POSTE ITALIANE SPA           | —                | 29             | 17               | 2,195                       | 金融         |
| ENI SPA                      | 39               | 72             | 110              | 13,605                      | エネルギー      |
| LEONARDO SPA                 | 5                | 5              | 6                | 823                         | 資本財・サービス   |
| BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA | 50.19            | —              | —                | —                           | その他        |
| ENEL SPA                     | 108              | 248            | 102              | 12,642                      | 公益事業       |
| SNAM SPA                     | 41               | 89             | 34               | 4,220                       | エネルギー      |
| LUXOTTICA GROUP SPA          | 3                | 8              | 37               | 4,642                       | 一般消費財・サービス |
| UBI BANCA SPA                | 20               | —              | —                | —                           | 金融         |

| 銘柄                          | 期首               |                      | 期末                   |                   | 業種等        |
|-----------------------------|------------------|----------------------|----------------------|-------------------|------------|
|                             | 株数               | 株数                   | 評価額                  | 評価額               |            |
|                             |                  |                      | 外貨建金額                | 邦貨換算金額            |            |
| TERNA SPA                   | 百株               | 百株                   | 千ユーロ                 | 千円                | 公益事業       |
|                             | 37               | 37                   | 15                   | 1,963             |            |
| 国小計                         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 849<br>17銘柄          | 1,502.31<br>15銘柄     | 604<br>< 0.6%>    |            |
| ユーロ (フィンランド)                | 百株               | 百株                   | 千ユーロ                 | 千円                |            |
| UPM-KYMMENE OYJ             | 8                | 20.5                 | 47                   | 5,846             | 素材         |
| NOKIA OYJ                   | 57               | 161                  | 73                   | 9,045             | 情報技術       |
| WARTSILA OYJ ABP            | 3                | 3                    | 12                   | 1,568             | 資本財・サービス   |
| STORA ENSO OYJ-R SHS        | —                | 20                   | 20                   | 2,465             | 素材         |
| METSO OYJ                   | 3                | 3                    | 8                    | 1,009             | 資本財・サービス   |
| ELISA OYJ                   | 2.5              | 2.5                  | 7                    | 963               | 電気通信サービス   |
| SAMPO OYJ-A SHS             | 7                | 11                   | 48                   | 5,952             | 金融         |
| FORTUM OYJ                  | 7                | 7                    | 10                   | 1,275             | 公益事業       |
| KONE OYJ-B                  | 6                | 13                   | 55                   | 6,863             | 資本財・サービス   |
| NOKIA RENKAAT OYJ           | —                | 7                    | 25                   | 3,149             | 一般消費財・サービス |
| NESTE OYJ                   | 4                | 4                    | 13                   | 1,615             | エネルギー      |
| ORION OYJ-CLASS B           | —                | 5                    | 21                   | 2,671             | ヘルスケア      |
| 国小計                         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 97.5<br>9銘柄          | 257<br>12銘柄          | 345<br>< 0.3%>    |            |
| ユーロ (オーストリア)                | 百株               | 百株                   | 千ユーロ                 | 千円                |            |
| OMV AG                      | 6                | 6                    | 20                   | 2,508             | エネルギー      |
| ERSTE GROUP BANK AG         | 4                | 10.5                 | 30                   | 3,775             | 金融         |
| VOESTALPINE AG              | 2                | 8                    | 29                   | 3,613             | 素材         |
| 国小計                         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 12<br>3銘柄            | 24.5<br>3銘柄          | 80<br>< 0.1%>     |            |
| ユーロ (その他)                   | 百株               | 百株                   | 千ユーロ                 | 千円                |            |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | —                | 5                    | 15                   | 1,858             | 生活必需品      |
| STMICROELECTRONICS NV       | 12               | 12                   | 12                   | 1,547             | 情報技術       |
| 国小計                         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 12<br>1銘柄            | 17<br>2銘柄            | 27<br>< 0.0%>     |            |
| ユーロ通貨計                      | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 3,139.26<br>179銘柄    | 7,487.57<br>205銘柄    | 11,182<br><11.2%> |            |
| ファンド合計                      | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 16,929.03<br>1,035銘柄 | 37,223.84<br>1,175銘柄 | —<br><91.1%>      |            |

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2) 投資信託証券

| 銘柄                           | 期首               |                | 期末             |                 |
|------------------------------|------------------|----------------|----------------|-----------------|
|                              | 口数               | 口数             | 評価額            | 評価額             |
|                              |                  |                | 外貨建金額          | 邦貨換算金額          |
| (アメリカ)                       | 千口               | 千口             | 千アメリカ・ドル       | 千円              |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 0.222            | 0.372          | 65             | 7,644           |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 0.444            | 0.934          | 173            | 20,135          |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 0.3              | 0.55           | 71             | 8,306           |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES    | 0.8              | 1.7            | 43             | 5,036           |
| VORNADO REALTY TRUST         | 0.356            | 0.606          | 64             | 7,453           |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 0.6              | 1              | 64             | 7,475           |
| EQUINIX INC                  | 0.104            | 0.234          | 87             | 10,126          |
| AMERICAN TOWER CORP          | 0.6              | 1.3            | 136            | 15,831          |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 1.328            | 2.728          | 49             | 5,757           |
| KIMCO REALTY CORP            | 0.6              | 1.8            | 46             | 5,337           |
| PARK HOTELS & RESORTS INC    | —                | 0.35           | 10             | 1,190           |
| PLUM CREEK TIMBER CO         | 0.4              | —              | —              | —               |
| VENTAS INC                   | 0.5              | 1.25           | 79             | 9,197           |
| WEYERHAEUSER CO              | 0.864            | 2.504          | 77             | 8,992           |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 0.7              | 0.7            | 13             | 1,531           |
| BRIMMOR PROPERTY GROUP INC   | —                | 1.4            | 34             | 3,993           |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 0.45             | 1.15           | 98             | 11,432          |
| IRON MOUNTAIN INC            | 0.218            | 0.918          | 30             | 3,540           |
| VEREIT INC                   | 1.2              | 4.35           | 38             | 4,418           |
| PROLOGIS INC                 | 0.665            | 1.465          | 78             | 9,122           |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | —                | 0.2            | 22             | 2,575           |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | —                | 0.3            | 25             | 2,922           |
| DUKE REALTY CORP             | —                | 0.8            | 21             | 2,493           |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 0.1              | 0.25           | 57             | 6,688           |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 0.2              | 0.25           | 35             | 4,136           |
| WELLTOWER INC                | 0.6              | 1.2            | 82             | 9,517           |
| HCP INC                      | 0.7              | 1.2            | 36             | 4,287           |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 0.3              | 0.3            | 12             | 1,396           |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | —                | 0.45           | 43             | 5,082           |
| MACERICH CO/THE              | 0.3              | 0.3            | 21             | 2,484           |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 1.5              | 3.7            | 37             | 4,384           |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | —                | 0.65           | 29             | 3,411           |
| REALTY INCOME CORP           | —                | 0.95           | 56             | 6,543           |
| PUBLIC STORAGE               | 0.25             | 0.45           | 102            | 11,834          |
| REGENCY CENTERS CORP         | 0.3              | 0.3            | 20             | 2,411           |
| SL GREEN REALTY CORP         | —                | 0.4            | 42             | 4,983           |
| UDR INC                      | —                | 1.2            | 43             | 5,016           |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 0.3              | 0.55           | 56             | 6,556           |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | —                | 0.5            | 39             | 4,537           |
| アメリカ・ドル<br>通貨計               | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 14.901<br>28銘柄 | 39.261<br>38銘柄 | 2,050<br><1.9%> |
| (オーストラリア)                    | 千口               | 千口             | 千オーストラリア・ドル    | 千円              |
| SCENTRE GROUP                | 12.629           | 22.429         | 105            | 8,958           |
| DEXUS PROPERTY GROUP         | —                | 2.5            | 23             | 2,024           |
| GPT GROUP                    | 6.82             | 6.82           | 34             | 2,932           |
| MIRVAC GROUP                 | 13.9             | 13.9           | 29             | 2,521           |
| STOCKLAND                    | 6.1              | 6.1            | 27             | 2,384           |
| WESTFIELD CORP               | 2.6              | 5.6            | 53             | 4,530           |
| GOODMAN GROUP                | 3.7              | 8.8            | 62             | 5,350           |
| VICINITY CENTRES             | 4.523            | 19.523         | 58             | 4,987           |
| オーストラリア・ドル<br>通貨計            | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 50.272<br>7銘柄  | 85.672<br>8銘柄  | 395<br><0.3%>   |

| 銘 柄                          |         | 期 首    |         | 期 末        |         |
|------------------------------|---------|--------|---------|------------|---------|
|                              |         | 口 数    | 口 数     | 評 価 額      | 評 価 額   |
| (香港)                         |         | 千口     | 千口      | 千香港ドル      | 千円      |
| LINK REIT                    |         | 3      | 9.5     | 499        | 7,470   |
| 香 港 ド ル 通 貨 計                | 口数、金額   | 3      | 9.5     | 499        | 7,470   |
|                              | 銘柄数<比率> | 1銘柄    | 1銘柄     |            | <0.1%>  |
| (シンガポール)                     |         | 千口     | 千口      | 千シンガポール・ドル | 千円      |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT |         | —      | 12      | 28         | 2,307   |
| CAPITALAND MALL TRUST        |         | 9      | 9       | 17         | 1,428   |
| シンガポール・ドル 通 貨 計              | 口数、金額   | 9      | 21      | 46         | 3,736   |
|                              | 銘柄数<比率> | 1銘柄    | 2銘柄     |            | <0.0%>  |
| (イギリス)                       |         | 千口     | 千口      | 千イギリス・ポンド  | 千円      |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    |         | 0.9    | 3.05    | 31         | 4,441   |
| SEGRO PLC                    |         | 1.52   | 1.52    | 7          | 1,005   |
| HAMMERSON PLC                |         | 1.2    | 1.2     | 6          | 957     |
| BRITISH LAND CO PLC          |         | 2.3    | 2.3     | 14         | 2,027   |
| イギリス・ポンド 通 貨 計               | 口数、金額   | 5.92   | 8.07    | 59         | 8,431   |
|                              | 銘柄数<比率> | 4銘柄    | 4銘柄     |            | <0.1%>  |
| ユーロ (フランス)                   |         | 千口     | 千口      | 千ユーロ       | 千円      |
| UNIBAIL – RODAMCO SE         |         | 0.15   | 0.37    | 82         | 10,173  |
| GECINA SA                    |         | —      | 0.14    | 17         | 2,207   |
| KLEPIERRE                    |         | 0.2    | 0.6     | 21         | 2,700   |
| ユーロ通貨計                       | 口数、金額   | 0.35   | 1.11    | 122        | 15,081  |
|                              | 銘柄数<比率> | 2銘柄    | 3銘柄     |            | <0.1%>  |
| 合 計                          | 口数、金額   | 83.443 | 164.613 | —          | 306,200 |
|                              | 銘柄数<比率> | 43銘柄   | 56銘柄    |            | <2.5%>  |

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

| 銘 柄 別 |                             | 当 期 末      |          |
|-------|-----------------------------|------------|----------|
|       |                             | 買 建 額      | 売 建 額    |
| 外     | S&P500 (アメリカ)               | 百万円<br>459 | 百万円<br>— |
|       | S&P500 E-MINI FUTURE (アメリカ) | 65         | —        |
|       | FT 100 (イギリス)               | 70         | —        |
| 国     | EURO STOXX 50 (ドイツ)         | 93         | —        |

(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

2017年1月10日現在

| 項 目          | 当 期 末            |           |
|--------------|------------------|-----------|
|              | 評 価 額            | 比 率       |
| 株式           | 千円<br>11,208,630 | %<br>88.5 |
| 投資信託証券       | 306,200          | 2.4       |
| コール・ローン等、その他 | 1,154,152        | 9.1       |
| 投資信託財産総額     | 12,668,982       | 100.0     |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。  
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、1月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝115.96円、1カナダ・ドル＝87.72円、1オーストラリア・ドル＝85.16円、1香港ドル＝14.95円、1シンガポール・ドル＝80.79円、1ニュージーランド・ドル＝81.36円、1イギリス・ポンド＝140.83円、1イスラエル・シェケル＝30.16円、1スイス・フラン＝114.37円、1デンマーク・クローネ＝16.52円、1ノルウェー・クローネ＝13.58円、1スウェーデン・クローネ＝12.83円、1ユーロ＝122.78円です。  
(注3) 当期末における外貨建純資産 (11,988,881千円) の投資信託財産総額 (12,668,982千円) に対する比率は、94.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年1月10日現在

| 項 目            | 当 期 末           |
|----------------|-----------------|
| (A) 資産         | 24,539,159,531円 |
| コール・ローン等       | 772,646,523     |
| 株式(評価額)        | 11,208,630,134  |
| 投資信託証券(評価額)    | 306,200,468     |
| 未収入金           | 12,032,120,677  |
| 未収配当金          | 13,767,352      |
| 差入委託証拠金        | 205,794,377     |
| (B) 負債         | 12,237,297,155  |
| 未払金            | 12,237,297,155  |
| (C) 純資産総額(A－B) | 12,301,862,376  |
| 元本             | 7,765,887,299   |
| 次期繰越損益金        | 4,535,975,077   |
| (D) 受益権総口数     | 7,765,887,299口  |
| 1万口当り基準価額(C／D) | 15,841円         |

\* 期首における元本額は3,950,340,521円、当期中における追加設定元本額は4,607,939,602円、同解約元本額は792,392,824円です。  
\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 4,451,587,527円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 880,692,967円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 2,433,606,805円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は15,841円です。

## ■損益の状況

当期 自2016年1月13日 至2017年1月10日

| 項 目                      | 当 期            |
|--------------------------|----------------|
| (A) 配当等収益                | 144,575,633円   |
| 受取配当金                    | 143,741,742    |
| 受取利息                     | 90,123         |
| その他収益金                   | 815,203        |
| 支払利息                     | △ 71,435       |
| (B) 有価証券売買損益             | 939,871,022    |
| 売買益                      | 2,765,576,221  |
| 売買損                      | △1,825,705,199 |
| (C) 先物取引等損益              | 97,647,286     |
| 取引益                      | 107,163,411    |
| 取引損                      | △ 9,516,125    |
| (D) その他費用                | △ 9,089,255    |
| (E) 当期損益金(A + B + C + D) | 1,173,004,686  |
| (F) 前期繰越損益金              | 1,366,965,369  |
| (G) 解約差損益金               | △ 366,270,176  |
| (H) 追加信託差損益金             | 2,362,275,198  |
| (I) 合計(E + F + G + H)    | 4,535,975,077  |
| 次期繰越損益金(I)               | 4,535,975,077  |

(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》

## ■投資信託証券への投資制限の変更

当ファンドにおいて、投資信託証券への投資比率の上限を純資産総額の5%としていますが、上場投資信託については、この制限の適用除外とし、5%を超えて投資できることとする変更を行ないました。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                        |
|--------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 商品分類                                 | 追加型投信／海外／株式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                        |
| 信託期間                                 | 無期限                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                        |
| 運用方針                                 | 海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行います。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                        |
| 主要投資対象                               | ベビーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | イ、外国株式インデックスマザーファンドの受益証券<br>ロ、ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券                                                     |
|                                      | 外国株式インデックスマザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 外国の株式（預託証券を含みます。）                                                                                                      |
|                                      | ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | １．新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。）<br>２．新興国の企業のＤＲ（預託証券）<br>３．FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすＥＴＦ（上場投資信託証券） |
| ベビーファンドの運用方法                         | ①主として、海外の株価指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。<br>②各マザーファンドの受益証券への投資にあたっては、下記の組入比率を目標に行ないます。<br>外国株式インデックスマザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の80%<br>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…信託財産の純資産総額の20%<br>③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                        |
| 外国株式インデックス・マザーファンドの運用方法              | ①主として外国の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。<br>②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                        |
| ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの運用方法 | ①主として、新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）（※）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運用を行ないます。<br>※効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすＥＴＦに投資する場合があります。<br>②株式およびＥＴＦの組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80％程度以上に維持することを基本とします。<br>③運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>④為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。 |                                                                                                                        |
| 組入制限                                 | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 無制限                                                                                                                    |
|                                      | 外国株式インデックス・マザーファンドの株式組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                        |
|                                      | ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの株式組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                        |
| 分配方針                                 | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                        |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

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）

運用報告書（全体版）  
第 1 期  
（決算日 2017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。

さて、「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）」は、このたび、第1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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）  
<http://www.daiwa-am.co.jp/>

設定以来の運用実績

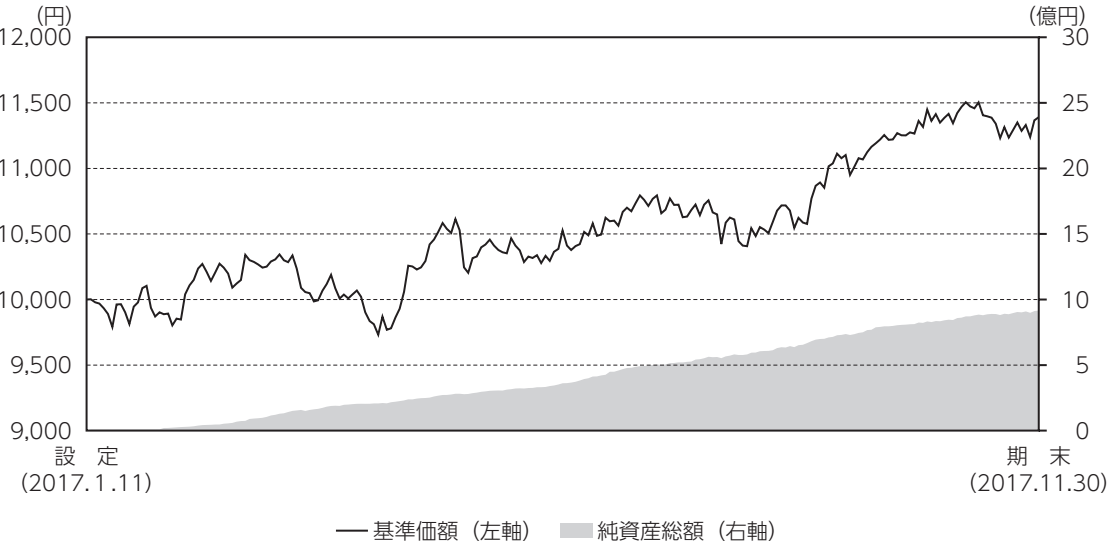
| 決 算 期             | 基 準 価 額     |           |           | 株 式 組 入 率<br>比 | 株 式 先 物 率<br>比 | 投 信 託 証 券 率<br>組 入 比 | 純 資 産 額<br>総 |
|-------------------|-------------|-----------|-----------|----------------|----------------|----------------------|--------------|
|                   |             | 税 込 分 配 金 | 期 中 騰 落 率 |                |                |                      |              |
| 1 期末(2017年11月30日) | 円<br>11,391 | 円<br>0    | %<br>13.9 | %<br>93.0      | %<br>1.5       | %<br>4.5             | 百万円<br>915   |

(注 1) 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 2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。  
(注 3) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



#### ■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円  
期 末：11,391円  
騰落率：13.9%

#### ■ 組入ファンドの当期中の騰落率と期末の組入比率

| 組入ファンド                          | 騰落率   | 比率    |
|---------------------------------|-------|-------|
| 外国株式インデックスマザーファンド               | 14.4% | 79.6% |
| ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド | 14.8% | 19.6% |

#### ■ 基準価額の主な変動要因

海外の株式市場の動きを反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。



| 年<br>月<br>日       | 基 準<br>価 額  | 騰 落 率  | 株 式 組 入 率<br>株 比 | 株 式 先 物 率<br>株 比 | 投 信 組 託 入 証 比 | 資 券 率<br>証 比 |
|-------------------|-------------|--------|------------------|------------------|---------------|--------------|
|                   |             |        |                  |                  |               |              |
| (設定) 2017年 1 月11日 | 円<br>10,000 | %<br>— | %<br>—           | %<br>—           |               | %<br>—       |
| 1 月末              | 9,936       | △ 0.6  | 94.2             | 1.1              |               | 3.5          |
| 2 月末              | 10,123      | 1.2    | 94.3             | 1.3              |               | 3.3          |
| 3 月末              | 10,188      | 1.9    | 94.7             | 1.0              |               | 2.9          |
| 4 月末              | 10,229      | 2.3    | 94.9             | 0.8              |               | 3.0          |
| 5 月末              | 10,360      | 3.6    | 94.6             | 1.3              |               | 2.9          |
| 6 月末              | 10,486      | 4.9    | 94.5             | 1.2              |               | 3.1          |
| 7 月末              | 10,628      | 6.3    | 94.1             | 1.4              |               | 3.5          |
| 8 月末              | 10,678      | 6.8    | 93.9             | 1.6              |               | 3.3          |
| 9 月末              | 11,068      | 10.7   | 95.0             | 0.9              |               | 3.0          |
| 10月末              | 11,344      | 13.4   | 93.9             | 1.3              |               | 3.6          |
| (期末) 2017年11月30日  | 11,391      | 13.9   | 93.0             | 1.5              |               | 4.5          |

(注) 騰落率は設定比。

## 投資環境について

(2017.1.11～2017.11.30)

### ■先進国株式市況

米国・欧州を中心とする先進国株式市況は、設定時より、米国トランプ大統領が石油パイプラインの建設を前進させる大統領令に署名したことや、大型減税を示唆したことにより景気拡大への期待が高まったことなどを背景に上昇しました。2017年4月以降は、朝鮮半島の緊迫化など地政学リスクへの警戒感を背景に神経質な展開となりましたが、フランス大統領選挙の結果が世論調査通りとなったことなどを受けて上昇し、その後も米国長期金利の上昇一服など良好な投資環境から堅調に推移しました。8月に入ると、北朝鮮に係る地政学リスクへの警戒が再燃したことやスペインでのテロ事件などから軟調な展開となりましたが、E C B（欧州中央銀行）が2017年のE U（欧州連合）圏の成長率見通しを引き上げたこと、トランプ政権が税制改革案を公表したことなどを支援材料として上昇し、期を通じては上昇して期末を迎えました。

### ■先進国為替相場

為替相場は、期を通じてユーロなどの欧州の通貨が対円で上昇しました。

設定時より、トランプ政権に対する期待感の後退や欧州の政治情勢の不透明感などから円高傾向となりました。2017年4月半ばからは、フランス大統領選挙の結果などを受けて、ユーロが上昇傾向となった一方で円は下落傾向となりました。5月にはいったん円高となる場面も見られましたが、6月中旬に入り先進各国の中央銀行が金融緩和姿勢を後退させる中で内外の金利差が拡大傾向となったことなどから、円は下落傾向となりました。7月以降は、地政学リスクの高まりなどから円高傾向となりました。9月以降は、米国の2017年中の追加利上げ観測の高まりなどを背景に円安が進み、米国の低インフレへの懸念などから円高に転じました。

### ■新興国株式市況

新興国株式市況は、米国を中心とした世界的な景気の堅調さが好感されてリスクをとる動きが強まった結果、資金流入が進み上昇基調となりました。

設定時より、中国での経済指標が予想を上回ったことなどから、アジアを中心に上昇して始まりました。2017年2月下旬からは、中国政府が金融規制強化の動きを強めたことが悪材料となりしばらくは上値が重い展開となりましたが、5月以降は、中国国内の堅調な消費や輸出が好感されたことや、F R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げペースが予想より緩やかという見方が強まったことで再び買われました。9月後半には米国大手通信機器メーカーの新製品発表がやや期待外れだったことで、ハイテク株を中心に一時調整したものの、米国の景気の底堅さなどを受けてリスク回避の動きが後退したことから、堅調に推移し期末を迎えました。

国別では、一帯一路関連をはじめとした政策期待が高まった中国株式市場や、物品サービス税の導入の成功やインフラ（社会基盤）投資等の景気対策が好材料となったインド株式市場などが買われました。

一方、米国との関係改善および経済制裁の緩和に対する期待が後退したロシア株式市場は下落しました。

## ■新興国為替相場

為替相場は、トランプ政権に対する期待の後退やF R Bの利上げが市場の想定より緩やかであったことから米ドルが相対的に売られた結果、全体として新興国通貨高となりました。

通貨別では、欧米との関係悪化などが悪材料となったトルコ・リラや、政治リスクが高まったブラジル・レアルは軟調でした。一方、トランプ政権成立後売られ過ぎたメキシコ・ペソは反発し、堅調な中国経済を背景としてインドネシア・ルピアを除くアジア通貨は買われました。

対米ドルでは円高が進んだものの、新興国通貨ほどの上昇ではなかったため、全体としてはやや円安新興国通貨高となりました。

## ポートフォリオについて

(2017.1.11~2017.11.30)

## ■当ファンド

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

## ■外国株式インデックスマザーファンド

外国株式を中心に、S & P 500先物取引も一部利用し、株式組入比率（投資信託証券、株式先物を含む。）につきましては、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（MSCIコクサイ指数（円ベース））との連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

## ■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

株式組入比率（DR（預託証券）、ETF（上場投資信託証券）、株価指数先物を含む。）は、FTSE RAFI エマージング インデックスのリバランス時や大量設定時を除き、期を通じて原則として96%以上で運用を行ないました。

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI エマージング インデックス採用銘柄の組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、DR等を組み入れることでベンチマーク（FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算））との連動性を維持するような運用を行ないました。

また、効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETFにも一部投資し、リバランス時には株価指数先物も利用しました。

## ベンチマークとの差異について

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

分配金について

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

■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目        |     | 当 期                        |
|------------|-----|----------------------------|
|            |     | 2017年1月11日<br>～2017年11月30日 |
| 当期分配金（税込み） | (円) | —                          |
| 対基準価額比率    | (%) | —                          |
| 当期の収益      | (円) | —                          |
| 当期の収益以外    | (円) | —                          |
| 翌期繰越分配対象額  | (円) | 1,390                      |

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



今後の運用方針

■当ファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、海外の株価指数に連動する投資成果をめざす「外国株式インデックスマザーファンド」に80％程度、「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」に20％程度投資し、海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行なってまいります。

■外国株式インデックスマザーファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、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なってまいります。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、主として新興国の株式（D Rを含む。）に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行なってまいります。

また、効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすE T Fにも一部投資します。なお、株式およびE T F の組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80％程度以上に維持することを基本とします。さらに、リバランス時等に、株式実質組入比率の維持を目的に株価指数先物取引の利用も検討します。

# 1万口当りの費用の明細

| 項 目       | 当期<br>(2017.1.11~2017.11.30) |         | 項 目 の 概 要                                                          |
|-----------|------------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------|
|           | 金 額                          | 比 率     |                                                                    |
| 信 託 報 酬   | 32円                          | 0.302%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は10,540円です。                       |
| (投 信 会 社) | (25)                         | (0.235) | 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、目<br>論見書・運用報告書の作成等の対価         |
| (販 売 会 社) | (5)                          | (0.048) | 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<br>の情報提供等の対価                |
| (受 託 銀 行) | (2)                          | (0.019) | 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   | 2                            | 0.021   | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株 式)     | (2)                          | (0.018) |                                                                    |
| (先 物)     | (0)                          | (0.001) |                                                                    |
| (投資信託証券)  | (0)                          | (0.003) |                                                                    |
| 有価証券取引税   | 1                            | 0.009   | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>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)                          | (0.009) |                                                                    |
| (投資信託証券)  | (0)                          | (0.000) |                                                                    |
| そ の 他 費 用 | 16                           | 0.147   | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数                                          |
| (保 管 費 用) | (14)                         | (0.129) | 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・<br>資産の移転等に要する費用             |
| (監 査 費 用) | (0)                          | (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)   | (1)                          | (0.014) | 信託事務の処理等に関するその他の費用                                                 |
| 合 計       | 51                           | 0.480   |                                                                    |

(注1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況  
親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

|                                         | 設 定     |         | 解 約   |        |
|-----------------------------------------|---------|---------|-------|--------|
|                                         | 口 数     | 金 額     | 口 数   | 金 額    |
|                                         | 千口      | 千円      | 千口    | 千円     |
| ダイワ新興国株式ファン<br>ダメンタル・インデック<br>ス・マザーファンド | 114,854 | 169,749 | 1,825 | 2,711  |
| 外国株式インデック<br>スマザーファンド                   | 309,912 | 684,225 | 4,875 | 10,684 |

(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  
(2017年1月11日から2017年11月30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     | 2,566,867千円                     |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 3,008,372千円                     |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.85                            |
|                   | 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     | 7,110,549千円                     |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 84,464,756千円                    |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.08                            |

(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  
当期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

| 設定時保有額 | 期中設定額 | 期中解約額 | 期末保有額 | 取 引 の 理 由        |
|--------|-------|-------|-------|------------------|
| 百万円    | 百万円   | 百万円   | 百万円   |                  |
| 10     | －     | 10    | －     | 当初設定時における取得とその処分 |

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

| 種 類                             | 当 期 末   |         |
|---------------------------------|---------|---------|
|                                 | 口 数     | 評 価 額   |
|                                 | 千口      | 千円      |
| ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド | 113,028 | 179,648 |
| 外国株式インデックスマザーファンド               | 305,036 | 728,762 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月30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 | 179,648 | 19.5  |
| 外国株式インデックスマザーファンド               | 728,762 | 79.0  |
| コール・ローン等、その他                    | 13,564  | 1.5   |
| 投資信託財産総額                        | 921,975 | 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＝112.05円、1カナダ・ドル＝87.10円、1オーストラリア・ドル＝84.87円、1香港ドル＝14.35円、1シンガポール・ドル＝83.19円、1ニュージーランド・ドル＝76.68円、1台湾ドル＝3.74円、1イギリス・ポンド＝150.33円、1イスラエル・シケル＝31.98円、1スイス・フラン＝113.83円、1トルコ・リラ＝28.31円、1デンマーク・クローネ＝17.84円、1ノルウェー・クローネ＝13.58円、1スウェーデン・クローネ＝13.38円、1メキシコ・ペソ＝6.03円、100チリ・ペソ＝17.40円、1インド・ルピー＝1.76円、100インドネシア・ルピア＝0.83円、1ブラジル・リアル＝34.53円、1マレーシア・リンギット＝27.42円、1南アフリカ・ランド＝8.20円、1タイ・バーツ＝3.44円、1ポーランド・ズロチ＝31.60円、1ユーロ＝132.81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（4,263,793千円）の投資信託財産総額（4,365,903千円）に対する比率は、97.7%です。  
外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（94,407,006千円）の投資信託財産総額（95,001,876千円）に対する比率は、99.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

| 項 目                                  | 当 期 末        |
|--------------------------------------|--------------|
| (A) 資産                               | 921,975,333円 |
| コール・ローン等                             | 12,964,275   |
| 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) | 179,648,120  |
| 外国株式インデックスマザーファンド(評価額)               | 728,762,938  |
| 未収入金                                 | 600,000      |
| (B) 負債                               | 6,349,290    |
| 未払解約金                                | 5,398,920    |
| 未払信託報酬                               | 935,594      |
| その他未払費用                              | 14,776       |
| (C) 純資産総額(A－B)                       | 915,626,043  |
| 元本                                   | 803,832,811  |
| 次期繰越損益金                              | 111,793,232  |
| (D) 受益権総口数                           | 803,832,811口 |
| 1万口当り基準価額(C／D)                       | 11,391円      |

\* 設定時における元本額は10,000,000円、当期中における追加設定元本額は866,066,727円、同解約元本額は72,233,916円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,391円です。

■損益の状況

当期 自2017年1月11日 至2017年11月30日

| 項 目                  | 当 期           |
|----------------------|---------------|
| (A) 配当等収益            | △ 1,981円      |
| 受取利息                 | 101           |
| 支払利息                 | △ 2,082       |
| (B) 有価証券売買損益         | 64,251,000    |
| 売買益                  | 68,009,647    |
| 売買損                  | △ 3,758,647   |
| (C) 信託報酬等            | △ 1,278,396   |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 62,970,623    |
| (E) 追加信託差損益金         | 48,822,609    |
| (配当等相当額)             | (△ 1,484)     |
| (売買損益相当額)            | ( 48,824,093) |
| (F) 合計(D + E)        | 111,793,232   |
| 次期繰越損益金(F)           | 111,793,232   |
| 追加信託差損益金             | 48,822,609    |
| (配当等相当額)             | (△ 1,484)     |
| (売買損益相当額)            | ( 48,824,093) |
| 分配準備積立金              | 62,972,604    |
| 繰越損益金                | △ 1,981       |

(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「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■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        | 62,972,604   |
| (c) 収益調整金                  | 48,824,093   |
| (d) 分配準備積立金                | 0            |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 111,796,697  |
| (f) 分配金                    | 0            |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e－f)         | 111,796,697  |
| (h) 受益権総口数                 | 803,832,811口 |



<補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の決算日（2017年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017年11月30日）現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を87～91ページに併せて掲載いたしました。

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

(1) 株 式

(2017年1月11日から2017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  |
|                                     |   | 千株     | 千円     | 円     |                                     |   | 千株    | 千円     | 円     |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)      |   | 824    | 75,630 | 91    | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル) |   | 154   | 73,468 | 477   |
| GAZPROM PAO -SPON ADR (ロシア)         |   | 108.24 | 53,627 | 495   | VALE SA-PREF (ブラジル)                 |   | 67.5  | 72,871 | 1,079 |
| IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)       |   | 675    | 50,751 | 75    | PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)    |   | 127.5 | 63,821 | 500   |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)   |   | 67     | 49,344 | 736   | VALE SA (ブラジル)                      |   | 43.4  | 49,220 | 1,134 |
| CHINA MOBILE LTD (香港)               |   | 38.5   | 47,600 | 1,236 | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル) |   | 21.8  | 29,950 | 1,373 |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル) |   | 80.3   | 42,637 | 530   | BANCO BRADESCO SA-PREF (ブラジル)       |   | 16.2  | 18,512 | 1,142 |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)    |   | 68.2   | 38,521 | 564   | SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR (ロシア)  |   | 13.95 | 17,828 | 1,278 |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)     |   | 101    | 36,862 | 364   | LUKOIL PJSC-SPON ADR (ロシア)          |   | 1.97  | 11,953 | 6,067 |
| LUKOIL PJSC-SPON ADR (ロシア)          |   | 6.17   | 36,414 | 5,901 | GERDAU SA-PREF (ブラジル)               |   | 15.7  | 7,089  | 451   |
| BANK OF CHINA LTD-H (中国)            |   | 646    | 35,927 | 55    | BANCO DO BRASIL S.A. (ブラジル)         |   | 5.8   | 6,945  | 1,197 |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

| 買                                   |   | 付     |         |       | 売                                   |   | 付   |         |       |
|-------------------------------------|---|-------|---------|-------|-------------------------------------|---|-----|---------|-------|
| 銘                                   | 柄 | 口 数   | 金 額     | 平均単価  | 銘                                   | 柄 | 口 数 | 金 額     | 平均単価  |
|                                     |   | 千口    | 千円      | 円     |                                     |   | 千口  | 千円      | 円     |
| POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT (アメリカ) |   | 347.5 | 822,636 | 2,367 | POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT (アメリカ) |   | 195 | 458,181 | 2,349 |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)  |   | 17.8  | 3,348   | 188   |                                     |   |     |         |       |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)  |   | 15    | 3,283   | 218   |                                     |   |     |         |       |
| REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)     |   | 17.93 | 1,688   | 94    |                                     |   |     |         |       |

(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、2017年11月30日現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド  
(2,723,283千口) の内容です。

(1) 外国株式

| 銘柄                           | 株数                              | 2017年11月30日現在 |                    | 業種等        |
|------------------------------|---------------------------------|---------------|--------------------|------------|
|                              |                                 | 評価額           |                    |            |
|                              |                                 | 外貨建金額         | 邦貨換算金額             |            |
| (アメリカ)                       | 百株                              | 千アメリカ・ドル      | 千円                 |            |
| SURGUTNEFTEGAS-SP ADR PREF   | 138                             | 67            | 7,530              | その他        |
| MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR    | 122.5                           | 128           | 14,398             | 電気通信サービス   |
| VTB BANK JSC -GDR-REG S      | 457.06                          | 86            | 9,694              | 金融         |
| TATNEFT PAO-SPONSORED ADR    | 28.4                            | 136           | 15,306             | エネルギー      |
| SURGUTNEFTEGAS-SP ADR        | 132.7                           | 63            | 7,119              | エネルギー      |
| MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR  | 52.6                            | 91            | 10,267             | 素材         |
| SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR | 27.9                            | 10            | 1,156              | 電気通信サービス   |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS    | 21.3                            | 56            | 6,300              | 生活必需品      |
| MEGAFON-REG S GDR            | 27.8                            | 27            | 3,068              | 電気通信サービス   |
| RUSHYDRO PJSC-ADR            | 143.9                           | 19            | 2,152              | 公益事業       |
| SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR | 366.1                           | 614           | 68,834             | 金融         |
| NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S | 5.3                             | 61            | 6,841              | エネルギー      |
| LUKOIL PJSC-SPON ADR         | 120                             | 681           | 76,306             | エネルギー      |
| ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR | 220.3                           | 110           | 12,428             | エネルギー      |
| GAZPROM PAO -SPON ADR        | 1,837.4                         | 838           | 93,984             | エネルギー      |
| SEVERSTAL - GDR REG S        | 22                              | 33            | 3,781              | 素材         |
| ROSSETI PJSC                 | 16,037.2                        | 23            | 2,680              | 公益事業       |
| INTER RAO UES PJSC           | 3,640.2                         | 22            | 2,558              | 公益事業       |
| ALROSA PJSC                  | 149.9                           | 19            | 2,232              | 素材         |
| INNER MONGOLIA YITAI COAL-B  | 177                             | 24            | 2,782              | エネルギー      |
| TRANSNEFT PJSC               | 0.13                            | 40            | 4,568              | エネルギー      |
| アメリカ・ドル<br>通貨計               | 23,727.69<br>株数、金額<br>計 銘柄数<比率> | 3,159<br>21銘柄 | 353,993<br>< 8.2%> |            |
| (香港)                         | 百株                              | 千香港ドル         | 千円                 |            |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H | 315                             | 285           | 4,095              | 資本財・サービス   |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H    | 600                             | 348           | 5,002              | 資本財・サービス   |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 140                             | 289           | 4,148              | 資本財・サービス   |
| KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS  | 110                             | 493           | 7,079              | 情報技術       |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 150                             | 419           | 6,016              | 一般消費財・サービス |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDIN  | 240                             | 520           | 7,473              | 生活必需品      |
| JIANGXI COPPER CO LTD-H      | 200                             | 243           | 3,495              | 素材         |
| SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD | 80                              | 178           | 2,560              | 資本財・サービス   |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 5,658                           | 3,168         | 45,467             | エネルギー      |
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS    | 60                              | 275           | 3,951              | 資本財・サービス   |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H  | 400                             | 392           | 5,625              | 一般消費財・サービス |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD     | 1,920                           | 172           | 2,479              | 一般消費財・サービス |
| CHINA COMMUNICATIONS SERH-H  | 380                             | 188           | 2,699              | 電気通信サービス   |
| FOSUN INTERNATIONAL LTD      | 210                             | 356           | 5,110              | 資本財・サービス   |
| TENCENT HOLDINGS LTD         | 52                              | 2,140         | 30,713             | 情報技術       |
| CHINA TELECOM CORP LTD-H     | 2,920                           | 1,103         | 15,838             | 電気通信サービス   |
| SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD   | 340                             | 117           | 1,688              | 一般消費財・サービス |
| CHINA UNICOM HONG KONG LTD   | 1,300                           | 1,497         | 21,490             | 電気通信サービス   |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD | 155                             | 240           | 3,447              | 不動産        |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 260                             | 387           | 5,566              | 公益事業       |
| PETROCHINA CO LTD-H          | 3,860                           | 2,022         | 29,024             | エネルギー      |
| CNOOC LTD                    | 3,490                           | 3,769         | 54,088             | エネルギー      |
| HUANENG POWER INTL INC-H     | 800                             | 399           | 5,728              | 公益事業       |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H  | 110                             | 425           | 6,108              | 素材         |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 310                             | 165           | 2,371              | 公益事業       |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 14,590                          | 10,037        | 144,044            | 金融         |
| CHINA MOBILE LTD             | 645                             | 5,163         | 74,092             | 電気通信サービス   |

| 銘 柄                           | 2017年11月30日現在      |                |                      | 業 種 等      |
|-------------------------------|--------------------|----------------|----------------------|------------|
|                               | 株 数                | 評 価 額          |                      |            |
|                               |                    | 外貨建金額          | 邦貨換算金額               |            |
|                               | 百株                 | 千香港ドル          | 千円                   |            |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD  | 188                | 584            | 8,390                | 金融         |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H   | 1,200              | 601            | 8,627                | 金融         |
| GF SECURITIES CO LTD-H        | 86                 | 136            | 1,957                | 金融         |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD      | 40                 | 309            | 4,439                | 生活必需品      |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CH-H   | 580                | 255            | 3,662                | 金融         |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-H     | 645                | 1,260          | 18,085               | エネルギー      |
| SINOPHARM GROUP CO-H          | 120                | 372            | 5,346                | ヘルスケア      |
| CHINA RESOURCES LAND LTD      | 280                | 631            | 9,060                | 不動産        |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO    | 110                | 234            | 3,362                | 一般消費財・サービス |
| YANZHOU COAL MINING CO-H      | 260                | 190            | 2,731                | エネルギー      |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H  | 4,430              | 1,608          | 23,076               | 金融         |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H  | 50                 | 259            | 3,727                | 金融         |
| PEOPLES INSURANCE CO GROU-H   | 1,150              | 466            | 6,700                | 金融         |
| CITIC LTD                     | 450                | 497            | 7,141                | 資本財・サービス   |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEMEN-H | 1,020              | 296            | 4,259                | 金融         |
| IND & COMM BK OF CHINA-H      | 12,510             | 7,693          | 110,403              | 金融         |
| GUANGDONG INVESTMENT LTD      | 180                | 191            | 2,748                | 公益事業       |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST  | 380                | 938            | 13,468               | 不動産        |
| CRRC CORP LTD - H             | 210                | 150            | 2,166                | 資本財・サービス   |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-H  | 550                | 478            | 6,866                | 資本財・サービス   |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H  | 400                | 3,200          | 45,920               | 金融         |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD      | 220                | 850            | 12,201               | 不動産        |
| CHINA MINSHENG BANKING-H      | 864                | 685            | 9,831                | 金融         |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO    | 850                | 1,091          | 15,661               | 不動産        |
| CHINA VANKE CO LTD-H          | 108                | 322            | 4,626                | 不動産        |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H    | 600                | 907            | 13,018               | 金融         |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H    | 205                | 187            | 2,697                | 一般消費財・サービス |
| WEICHAI POWER CO LTD-H        | 340                | 292            | 4,200                | 資本財・サービス   |
| CHINA POWER INTERNATIONAL     | 630                | 131            | 1,889                | 公益事業       |
| CHINA POWER INTERNATI-RIGHTS  | 210                | 5              | 72                   | その他        |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H  | 600                | 315            | 4,528                | 素材         |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H  | 238                | 928            | 13,319               | 金融         |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H     | 500                | 1,302          | 18,690               | 金融         |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD       | 60                 | 351            | 5,045                | 公益事業       |
| KUNLUN ENERGY CO LTD          | 380                | 257            | 3,697                | エネルギー      |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H  | 260                | 443            | 6,357                | 不動産        |
| CHINA OILFIELD SERVICES-H     | 220                | 160            | 2,304                | エネルギー      |
| LENOVO GROUP LTD              | 1,880              | 834            | 11,978               | 情報技術       |
| CHINA NATIONAL BUILDING MA-H  | 840                | 630            | 9,052                | 素材         |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H   | 1,381              | 802            | 11,513               | 金融         |
| CHINA EVERGRANDE GROUP        | 860                | 2,317          | 33,258               | 不動産        |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H  | 320                | 175            | 2,516                | 金融         |
| GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD  | 2,040              | 265            | 3,805                | 情報技術       |
| CHINA MERCHANTS BANK-H        | 495                | 1,551          | 22,268               | 金融         |
| BANK OF CHINA LTD-H           | 12,770             | 4,852          | 69,634               | 金融         |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H     | 155                | 263            | 3,785                | 金融         |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H  | 450                | 164            | 2,356                | 金融         |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H   | 180                | 209            | 3,001                | 金融         |
| LONGFOR PROPERTIES            | 195                | 365            | 5,243                | 不動産        |
| 香 港 ド ル<br>通 貨 計              | 株数・金額<br>計 銘柄数<比率> | 91,985<br>76銘柄 | 1,088,112<br><25.1%> |            |

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| 銘柄                           | 株数           | 2017年11月30日現在     |                               | 業種等        |
|------------------------------|--------------|-------------------|-------------------------------|------------|
|                              |              | 評価                | 価額                            |            |
|                              |              | 外貨建金額             | 邦貨換算金額                        |            |
| (台湾)                         | 百株           | 千台湾ドル             | 千円                            |            |
| TAIWAN CEMENT                | 320          | 1,084             | 4,057                         | 素材         |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 461.12       | 2,928             | 10,951                        | 生活必需品      |
| FORMOSA PLASTICS CORP        | 336          | 3,144             | 11,762                        | 素材         |
| NAN YA PLASTICS CORP         | 391.4        | 2,970             | 11,110                        | 素材         |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE    | 333.9        | 3,135             | 11,726                        | 素材         |
| WALSIN LIHWA CORP            | 440          | 704               | 2,632                         | 資本財・サービス   |
| CHINA STEEL CORP             | 806.86       | 1,972             | 7,378                         | 素材         |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 172.55       | 886               | 3,317                         | 一般消費財・サービス |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP      | 196.16       | 755               | 2,824                         | 情報技術       |
| DELTA ELECTRONICS INC        | 150          | 2,085             | 7,797                         | 情報技術       |
| ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR  | 659.29       | 2,604             | 9,739                         | 情報技術       |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD    | 91.41        | 778               | 2,912                         | 情報技術       |
| INVENTEC CORP                | 490          | 1,100             | 4,114                         | 情報技術       |
| TATUNG CO LTD                | 470          | 888               | 3,322                         | 一般消費財・サービス |
| QUANTA COMPUTER INC          | 260          | 1,653             | 6,184                         | 情報技術       |
| AU OPTRONICS CORP            | 2,610        | 3,406             | 12,738                        | 情報技術       |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD      | 404          | 4,221             | 15,789                        | 電気通信サービス   |
| MEDIATEK INC                 | 190.03       | 6,356             | 23,773                        | 情報技術       |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD    | 60           | 2,016             | 7,539                         | 情報技術       |
| HTC CORP                     | 222.57       | 1,526             | 5,710                         | 情報技術       |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD  | 388.22       | 1,153             | 4,312                         | 金融         |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO   | 854.11       | 4,240             | 15,860                        | 金融         |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO  | 936.93       | 4,928             | 18,431                        | 金融         |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO   | 571.2        | 1,068             | 3,994                         | 金融         |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO  | 718.28       | 1,002             | 3,747                         | 金融         |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 749.93       | 1,766             | 6,605                         | 金融         |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING    | 631.78       | 859               | 3,213                         | 金融         |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING  | 1,350.41     | 1,384             | 5,176                         | 金融         |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT | 1,640.28     | 3,296             | 12,330                        | 金融         |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO   | 732.58       | 1,424             | 5,329                         | 金融         |
| NOVATEK MICROELECTRONICS COR | 70           | 826               | 3,089                         | 情報技術       |
| TAIWAN MOBILE CO LTD         | 110          | 1,188             | 4,443                         | 電気通信サービス   |
| WISTRON CORP                 | 739.4        | 1,752             | 6,553                         | 情報技術       |
| INNOLUX CORP                 | 3,100        | 4,154             | 15,535                        | 情報技術       |
| TPK HOLDING CO LTD           | 110          | 971               | 3,632                         | 情報技術       |
| WPG HOLDINGS LTD             | 250          | 1,046             | 3,912                         | 情報技術       |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD  | 170          | 1,232             | 4,609                         | 電気通信サービス   |
| PEGATRON CORP                | 370          | 2,538             | 9,492                         | 情報技術       |
| RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR | 80           | 512               | 1,917                         | 情報技術       |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC     | 74           | 671               | 2,512                         | 情報技術       |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP   | 110          | 1,166             | 4,360                         | エネルギー      |
| POU CHEN                     | 144.4        | 531               | 1,987                         | 一般消費財・サービス |
| SILICONWARE PRECISION INDS   | 120          | 601               | 2,248                         | 情報技術       |
| COMPAL ELECTRONICS           | 374.53       | 775               | 2,899                         | 情報技術       |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 1,280        | 30,016            | 112,259                       | 情報技術       |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY   | 1,681.28     | 17,317            | 64,766                        | 情報技術       |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP   | 40           | 1,146             | 4,286                         | 生活必需品      |
| ASUSTEK COMPUTER INC         | 47.6         | 1,280             | 4,788                         | 情報技術       |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 1,150        | 1,805             | 6,752                         | 情報技術       |
| 台湾ドル通貨計                      | 株数、金額<br>通貨計 | 27,660.22<br>49銘柄 | 134,875<br>504,435<br><11.7%> |            |
| (トルコ)                        | 百株           | 千トルコ・リラ           | 千円                            |            |
| TURKIYE GARANTI BANKASI      | 326.5        | 304               | 8,623                         | 金融         |
| AKBANK T.A.S.                | 303.5        | 270               | 7,655                         | 金融         |
| TURKIYE IS BANKASI-C         | 271.7        | 165               | 4,676                         | 金融         |

| 銘柄                            | 株数           | 2017年11月30日現在     |                             | 業種等        |
|-------------------------------|--------------|-------------------|-----------------------------|------------|
|                               |              | 評価                | 価額                          |            |
|                               |              | 外貨建金額             | 邦貨換算金額                      |            |
|                               | 百株           | 千トルコ・リラ           | 千円                          |            |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS   | 139.2        | 204               | 5,781                       | 電気通信サービス   |
| TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFAINE | 28.2         | 339               | 9,620                       | エネルギー      |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK  | 178.31       | 152               | 4,331                       | 素材         |
| HACI OMER SABANCI HOLDING     | 189.3        | 195               | 5,541                       | 金融         |
| TURKIYE HALK BANKASI          | 153.6        | 135               | 3,826                       | 金融         |
| YAPI VE KREDI BANKASI         | 173.7        | 70                | 1,991                       | 金融         |
| TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D  | 231.3        | 127               | 3,621                       | 金融         |
| KOC HOLDING AS                | 112.55       | 181               | 5,139                       | 資本財・サービス   |
| TURK HAVA YOLLARI AO          | 184.9        | 220               | 6,229                       | 資本財・サービス   |
| BIR TELEKOMUNIKASYON AS       | 110          | 58                | 1,650                       | 電気通信サービス   |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS     | 22.7         | 164               | 4,643                       | 生活必需品      |
| トルコ・リラ通貨計                     | 株数、金額<br>通貨計 | 2,425.46<br>14銘柄  | 2,590<br>73,331<br><1.7%>   |            |
| (メキシコ)                        | 百株           | 千メキシコ・ペソ          | 千円                          |            |
| AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L  | 5,722        | 9,384             | 56,586                      | 電気通信サービス   |
| GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO    | 179          | 1,204             | 7,264                       | 一般消費財・サービス |
| CEMEX SAB-CPO                 | 2,096.19     | 3,041             | 18,340                      | 素材         |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICAJUD   | 186          | 3,124             | 18,841                      | 生活必需品      |
| GRUPO FIN SANTANDER-B         | 282          | 865               | 5,220                       | 金融         |
| COCA-COLA FEMSA SAB-SER L     | 51           | 653               | 3,942                       | 生活必需品      |
| MEXICHEM SAB DE CV-*          | 110.23       | 534               | 3,222                       | 素材         |
| GRUPO BIMBO SAB- SERIES A     | 103          | 454               | 2,741                       | 生活必需品      |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV  | 9.6          | 388               | 2,345                       | 素材         |
| ALFA S.A.B.-A                 | 504          | 1,029             | 6,205                       | 資本財・サービス   |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B  | 363          | 2,203             | 13,284                      | 素材         |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA-O    | 157          | 535               | 3,226                       | 金融         |
| WALMART DE MEXICO SAB DE CV   | 479          | 2,194             | 13,231                      | 生活必需品      |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE-O    | 215          | 2,364             | 14,258                      | 金融         |
| メキシコ・ペソ通貨計                    | 株数、金額<br>通貨計 | 10,457.02<br>14銘柄 | 27,978<br>168,711<br><3.9%> |            |
| (チリ)                          | 百株           | 千チリ・ペソ            | 千円                          |            |
| ENEL CHILE SA                 | 1,523.1      | 10,619            | 1,847                       | 公益事業       |
| ENEL GENERACION CHILE SA      | 266.8        | 14,207            | 2,472                       | 公益事業       |
| LATAM AIRLINES GROUP SA       | 40.9         | 34,639            | 6,027                       | 資本財・サービス   |
| CENCOSUD SA                   | 143.8        | 22,537            | 3,921                       | 生活必需品      |
| BANCO SANTANDER CHILE         | 7,526.8      | 33,900            | 5,898                       | 金融         |
| ENEL AMERICAS SA              | 2,489.2      | 30,900            | 5,376                       | 公益事業       |
| SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B  | 5            | 16,760            | 2,916                       | 素材         |
| S.A.C.I. FALABELLA            | 35.4         | 19,264            | 3,351                       | 一般消費財・サービス |
| BANCO DE CHILE                | 1,997.66     | 17,855            | 3,106                       | 金融         |
| チリ・ペソ通貨計                      | 株数、金額<br>通貨計 | 14,028.66<br>9銘柄  | 200,684<br>34,919<br><0.8%> |            |
| (インド)                         | 百株           | 千インド・ルピー          | 千円                          |            |
| TATA STEEL LTD                | 53.2         | 3,773             | 6,641                       | 素材         |
| AXIS BANK LTD                 | 88.6         | 4,868             | 8,568                       | 金融         |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD       | 3.2          | 2,774             | 4,883                       | 一般消費財・サービス |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD        | 25.6         | 3,266             | 5,749                       | 生活必需品      |
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP      | 106.3        | 4,425             | 7,789                       | エネルギー      |
| STATE BANK OF INDIA           | 224.9        | 7,396             | 13,018                      | 金融         |
| NTPC LTD                      | 197.6        | 3,596             | 6,329                       | 公益事業       |
| JSW STEEL LTD                 | 113.6        | 2,899             | 5,103                       | 素材         |
| INDIAN OIL CORP LTD           | 164.5        | 6,476             | 11,398                      | エネルギー      |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD     | 140.75       | 7,147             | 12,579                      | エネルギー      |
| IDEA CELLULAR LTD             | 150.6        | 1,406             | 2,475                       | 電気通信サービス   |
| TATA MOTORS LTD-A-DVR         | 44.4         | 1,056             | 1,859                       | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                              | 株数               | 2017年11月30日現在    |                                | 業種等        |
|---------------------------------|------------------|------------------|--------------------------------|------------|
|                                 |                  | 評価               | 価額                             |            |
|                                 |                  | 外貨建金額            | 邦貨換算金額                         |            |
| RURAL ELECTRIFICATION CORP      | 百株               | 千インド・ルピー         | 千円                             | 金融         |
| COAL INDIA LTD                  | 108.1            | 1,713            | 3,016                          | エネルギー      |
| NMDC LTD                        | 164.7            | 4,550            | 8,009                          | 素材         |
| INDIABULLS HOUSING FINANCE L    | 100.8            | 1,285            | 2,261                          | 金融         |
| GAIL INDIA LTD                  | 25.3             | 3,038            | 5,346                          | 公益事業       |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD         | 38               | 1,756            | 3,090                          | 素材         |
| WIPRO LTD                       | 170.1            | 4,199            | 7,391                          | 情報技術       |
| TATA CONSULTANCY SVCS LTD       | 77.2             | 2,305            | 4,057                          | 情報技術       |
| INFOSYS LTD                     | 19.58            | 5,204            | 9,160                          | 資本財・サービス   |
| LARSEN & TOUBRO LTD             | 108.1            | 10,622           | 18,696                         | 一般消費財・サービス |
| TATA MOTORS LTD                 | 22.42            | 2,730            | 4,805                          | 金融         |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE     | 126.6            | 5,240            | 9,223                          | 金融         |
| ICICI BANK LTD                  | 66               | 11,247           | 19,795                         | エネルギー      |
| RELIANCE INDUSTRIES LTD         | 207.34           | 6,528            | 11,489                         | エネルギー      |
| OIL & NATURAL GAS CORP LTD      | 358.6            | 33,923           | 59,705                         | 生活必需品      |
| ITC LTD                         | 458.75           | 8,369            | 14,731                         | 一般消費財・サービス |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD         | 95.4             | 2,461            | 4,332                          | 一般消費財・サービス |
| HERO MOTOCORP LTD               | 19.3             | 2,766            | 4,868                          | 電気通信サービス   |
| BHARTI AIRTEL LTD               | 4.7              | 1,718            | 3,024                          | ヘルスケア      |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS        | 107.6            | 5,334            | 9,388                          | 情報技術       |
| HCL TECHNOLOGIES LTD            | 26.5             | 1,449            | 2,551                          | 素材         |
| VEDANTA LTD                     | 23.3             | 1,987            | 3,498                          |            |
| インド・ルピー<br>通貨計                  | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 3,756.84<br>34銘柄 | 170,962<br>300,893<br>< 7.0%>  |            |
| (インドネシア)                        | 百株               | 千インドネシア・ルピア      | 千円                             |            |
| UNITED TRACTORS TBK PT          | 190              | 644,100          | 5,346                          | エネルギー      |
| ASTRA INTERNATIONAL TBK PT      | 1,575            | 1,315,125        | 10,915                         | 一般消費財・サービス |
| INDOFOOD SUKSES MAKUR TBK P     | 394              | 299,440          | 2,485                          | 生活必需品      |
| TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSER | 3,894            | 1,635,480        | 13,574                         | 電気通信サービス   |
| BANK NEGARA INDONESIA PERSER    | 790              | 663,600          | 5,507                          | 金融         |
| BANK CENTRAL ASIA TBK PT        | 474              | 1,003,695        | 8,330                          | 金融         |
| BANK MANDIRI PERSERO TBK PT     | 2,323            | 1,719,020        | 14,267                         | 金融         |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER    | 1,687            | 289,320          | 2,401                          | 公益事業       |
| BANK RAKYAT INDONESIA PERSER    | 4,675            | 1,542,750        | 12,804                         | 金融         |
| ADARO ENERGY TBK PT             | 1,712            | 303,880          | 2,522                          | エネルギー      |
| インドネシア・ルピア<br>通貨計               | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 17,714<br>10銘柄   | 9,416,410<br>78,156<br>< 1.8%> |            |
| (ブラジル)                          | 百株               | 千ブラジル・リアル        | 千円                             |            |
| PPLA PARTICIPATIONS LTD         | 3.33             | 0                | 18                             | 金融         |
| BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT       | 30               | 57               | 1,983                          | 金融         |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR    | 972              | 1,490            | 51,452                         | エネルギー      |
| BANCO BRADESCO SA-PREF          | 397.4            | 1,305            | 45,091                         | 金融         |
| ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF    | 419.24           | 1,755            | 60,626                         | 金融         |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA     | 120              | 90               | 3,115                          | 素材         |
| VALE SA                         | 562.9            | 2,009            | 69,389                         | 素材         |
| GERDAU SA-PREF                  | 215              | 238              | 8,240                          | 素材         |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS       | 842              | 1,339            | 46,257                         | エネルギー      |
| CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF    | 294.97           | 207              | 7,150                          | 公益事業       |
| ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR    | 231.29           | 242              | 8,377                          | 金融         |
| BRASKEM SA-PREF A               | 22               | 100              | 3,467                          | 素材         |
| CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B    | 27               | 61               | 2,112                          | 公益事業       |
| BANCO DO BRASIL S.A.            | 258              | 803              | 27,759                         | 金融         |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIR    | 34               | 67               | 2,346                          | 公益事業       |
| CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB    | 42               | 101              | 3,509                          | 公益事業       |

| 銘柄                           | 株数               | 2017年11月30日現在    |                               | 業種等        |
|------------------------------|------------------|------------------|-------------------------------|------------|
|                              |                  | 評価               | 価額                            |            |
|                              |                  | 外貨建金額            | 邦貨換算金額                        |            |
| EMBRAER SA                   | 百株               | 千ブラジル・リアル        | 千円                            | 資本財・サービス   |
| METALURGICA GERDAU SA-PREF   | 103              | 160              | 5,530                         | 素材         |
| CCR SA                       | 516              | 264              | 9,140                         | 資本財・サービス   |
| BRF SA                       | 62               | 99               | 3,425                         | 生活必需品      |
| NATURA COSMETICOS SA         | 82               | 322              | 11,124                        | 生活必需品      |
| CIA SANEAMENTO BASICO DE SP  | 25               | 74               | 2,576                         | 公益事業       |
| CIA ENERGETICA DE SP-PREF B  | 37               | 122              | 4,235                         | 公益事業       |
| TIM PARTICIPACOES SA         | 37               | 46               | 1,591                         | 公益事業       |
| TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF  | 104.26           | 126              | 4,370                         | 電気通信サービス   |
| CPFL ENERGIA SA              | 61               | 292              | 10,101                        | 電気通信サービス   |
| LOJAS RENNER S.A.            | 35.87            | 90               | 3,131                         | 公益事業       |
| JBS SA                       | 32.5             | 111              | 3,838                         | 一般消費財・サービス |
| ENGIE BRASIL ENERGIA SA      | 170              | 132              | 4,578                         | 生活必需品      |
| MARFRIG GLOBAL FOODS SA      | 24               | 86               | 2,992                         | 公益事業       |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO    | 90               | 62               | 2,162                         | 生活必需品      |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA    | 91               | 213              | 7,384                         | 金融         |
| CIELO SA                     | 55.08            | 67               | 2,326                         | 不動産        |
| FIBRIA CELULOSE SA           | 68.28            | 156              | 5,420                         | 情報技術       |
| CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF   | 27               | 129              | 4,456                         | 素材         |
| EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD  | 45               | 319              | 11,026                        | 生活必需品      |
| BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT  | 10               | 64               | 2,230                         | 公益事業       |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA    | 45               | 132              | 4,576                         | 金融         |
| KROTON EDUCACIONAL SA        | 52               | 365              | 12,633                        | エネルギー      |
| BANCO BRADESCO S.A.          | 68               | 123              | 4,273                         | 一般消費財・サービス |
| AMBEV SA                     | 86.17            | 264              | 9,134                         | 金融         |
| ブラジル・リアル<br>通貨計              | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 6,747.29<br>41銘柄 | 14,420<br>497,939<br>< 11.5%> |            |
| (マレーシア)                      | 百株               | 千マレーシア・リンギット     | 千円                            |            |
| MALAYAN BANKING BHD          | 467              | 429              | 11,780                        | 金融         |
| GENTING BHD                  | 136              | 121              | 3,330                         | 一般消費財・サービス |
| PUBLIC BANK BERHAD           | 273              | 553              | 15,165                        | 金融         |
| SIME DARBY BERHAD            | 457              | 408              | 11,202                        | 資本財・サービス   |
| AXIATA GROUP BERHAD          | 183              | 97               | 2,669                         | 電気通信サービス   |
| KUALA LUMPUR KEPONG BHD      | 37               | 90               | 2,471                         | 生活必需品      |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 234              | 174              | 4,792                         | 素材         |
| GENTING MALAYSIA BHD         | 217              | 111              | 3,052                         | 一般消費財・サービス |
| IOI CORP BHD                 | 169              | 75               | 2,057                         | 生活必需品      |
| CIMB GROUP HOLDINGS BHD      | 739              | 438              | 12,036                        | 金融         |
| TENAGA NASIONAL BHD          | 429              | 660              | 18,115                        | 公益事業       |
| PETRONAS GAS BHD             | 75               | 121              | 3,323                         | 公益事業       |
| DIGI.COM BHD                 | 269              | 123              | 3,392                         | 電気通信サービス   |
| SAPURA ENERGY BHD            | 843              | 104              | 2,866                         | エネルギー      |
| マレーシア・リンギット<br>通貨計           | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 4,528<br>14銘柄    | 3,510<br>96,257<br>< 2.2%>    |            |
| (南アフリカ)                      | 百株               | 千南アフリカ・ランド       | 千円                            |            |
| GOLD FIELDS LTD              | 208.6            | 1,210            | 9,922                         | 素材         |
| STEINHOFF INTERNATIONAL H NV | 174              | 983              | 8,061                         | 一般消費財・サービス |
| VODACOM GROUP LTD            | 65.9             | 958              | 7,859                         | 電気通信サービス   |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD        | 42.6             | 967              | 7,929                         | 生活必需品      |
| NEDBANK GROUP LTD            | 29.3             | 665              | 5,457                         | 金融         |
| BIDVEST GROUP LTD            | 24.2             | 470              | 3,855                         | 資本財・サービス   |
| BID CORP LTD                 | 33.9             | 1,010            | 8,283                         | 生活必需品      |
| NETCARE LTD                  | 104.6            | 234              | 1,922                         | ヘルスケア      |
| STANDARD BANK GROUP LTD      | 190.8            | 3,304            | 27,093                        | 金融         |

| 銘柄                           | 株数               | 2017年11月30日現在   |                   | 業種等        |
|------------------------------|------------------|-----------------|-------------------|------------|
|                              |                  | 評価額             | 価額                |            |
|                              |                  | 外貨建金額           | 邦貨換算金額            |            |
|                              | 百株               | 千円              | 千円                |            |
| IMPERIAL HOLDINGS LTD        | 36.4             | 837             | 6,865             | 一般消費財・サービス |
| SASOL LTD                    | 117.7            | 5,006           | 41,052            | 素材         |
| REMGRO LTD                   | 30.1             | 640             | 5,248             | 金融         |
| EXXARO RESOURCES LTD         | 23.9             | 365             | 2,997             | エネルギー      |
| KUMBA IRON ORE LTD           | 18.8             | 593             | 4,867             | 素材         |
| PICK N PAY STORES LTD        | 37.7             | 234             | 1,919             | 生活必需品      |
| TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD  | 41.6             | 332             | 2,727             | 一般消費財・サービス |
| SANLAM LTD                   | 188.4            | 1,492           | 12,235            | 金融         |
| TIGER BRANDS LTD             | 10.5             | 430             | 3,526             | 生活必需品      |
| FIRSTRAND LTD                | 313.1            | 1,785           | 14,641            | 金融         |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD      | 75.8             | 441             | 3,621             | 一般消費財・サービス |
| THE FOSCHINI GROUP LTD       | 16.8             | 265             | 2,173             | 一般消費財・サービス |
| BARCLAYS AFRICA GROUP LTD    | 83.9             | 1,329           | 10,904            | 金融         |
| NASPERS LTD-N SHS            | 11.3             | 4,304           | 35,294            | 一般消費財・サービス |
| INVESTEC LTD                 | 31               | 295             | 2,426             | 金融         |
| MTN GROUP LTD                | 391.9            | 5,028           | 41,236            | 電気通信サービス   |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 149.3            | 633             | 5,198             | 素材         |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 13.8             | 432             | 3,547             | ヘルスケア      |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD        | 48.1             | 680             | 5,580             | 素材         |
| BARLOWORLD LTD               | 48.4             | 724             | 5,943             | 資本財・サービス   |
| SAPPI LIMITED                | 81.9             | 822             | 6,740             | 素材         |
| TELKOM SA SOC LTD            | 40.9             | 198             | 1,626             | 電気通信サービス   |
| MONDI LTD                    | 8.4              | 276             | 2,264             | 素材         |
| MMI HOLDINGS LTD             | 130.1            | 265             | 2,174             | 金融         |
| SPAR GROUP LIMITED/THE       | 21.7             | 417             | 3,419             | 生活必需品      |
| MR PRICE GROUP LTD           | 15.9             | 338             | 2,776             | 一般消費財・サービス |
| LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN | 96               | 254             | 2,083             | ヘルスケア      |
| SIBANYE GOLD LTD             | 147              | 279             | 2,287             | 素材         |
| BRAIT SE                     | 36.4             | 164             | 1,349             | 金融         |
| 南アフリカ・ランド<br>通貨計             | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 3,140.7<br>38銘柄 | 38,673<br>< 7.3%> |            |
| (タイ)                         | 百株               | 千円              | 千円                |            |
| BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG | 58               | 1,264           | 4,349             | 金融         |
| SIAM CEMENT PCL-NVDR         | 33               | 1,590           | 5,471             | 素材         |
| KASIKORN BANK PCL-FOREIGN    | 49               | 1,146           | 3,944             | 金融         |
| KASIKORN BANK PCL-NVDR       | 32               | 732             | 2,520             | 金融         |
| SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR  | 274              | 4,096           | 14,091            | 金融         |
| THANACHART CAPITAL PCL-NVDR  | 169              | 937             | 3,226             | 金融         |
| ADVANCED INFO SERVICE-NVDR   | 154              | 2,710           | 9,323             | 電気通信サービス   |
| KRUNG THAI BANK - NVDR       | 932              | 1,808           | 6,219             | 金融         |
| BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR     | 615              | 1,045           | 3,596             | エネルギー      |
| PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR   | 282              | 2,594           | 8,924             | エネルギー      |
| IRPC PCL - NVDR              | 1,788            | 1,108           | 3,813             | エネルギー      |
| BANGCHAK CORP PCL-NVDR       | 231              | 877             | 3,019             | エネルギー      |
| PTT PCL-NVDR                 | 289              | 11,906          | 40,959            | エネルギー      |
| THAI OIL PCL-NVDR            | 193              | 1,838           | 6,323             | エネルギー      |
| CP ALL PCL-NVDR              | 257              | 1,901           | 6,542             | 生活必需品      |
| TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR  | 189              | 803             | 2,763             | 電気通信サービス   |
| CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR  | 619              | 1,504           | 5,174             | 生活必需品      |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 366              | 2,900           | 9,977             | 素材         |
| タイ・パーツ<br>通貨計                | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 6,530<br>18銘柄   | 40,768<br>< 3.2%> |            |

| 銘柄                           | 株数               | 2017年11月30日現在       |                       | 業種等   |
|------------------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------|
|                              |                  | 評価額                 | 価額                    |       |
|                              |                  | 外貨建金額               | 邦貨換算金額                |       |
|                              | 百株               | 千円                  | 千円                    |       |
| (ポーランド)                      | 百株               | 千円                  | 千円                    |       |
| PKO BANK POLSKI SA           | 97.4             | 409                 | 12,926                | 金融    |
| BANK PEKAO SA                | 24               | 307                 | 9,722                 | 金融    |
| POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 110.3            | 494                 | 15,614                | 金融    |
| POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I  | 162              | 97                  | 3,081                 | エネルギー |
| PGE SA                       | 140.9            | 169                 | 5,351                 | 公益事業  |
| POLSKI CONCERN NAFTOWY ORLEN | 57.3             | 664                 | 21,003                | エネルギー |
| TAURON POLSKA ENERGIA SA     | 284.4            | 87                  | 2,768                 | 公益事業  |
| ENERGA SA                    | 94               | 117                 | 3,710                 | 公益事業  |
| KGHM POLSKA MIEDZ SA         | 35.8             | 384                 | 12,149                | 素材    |
| ポーランド・ズロチ<br>通貨計             | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,006.1<br>9銘柄      | 2,731<br>< 2.0%>      |       |
| ファンド合計                       | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 213,706.98<br>347銘柄 | 3,740,442<br>< 86.4%> |       |

(注1) 邦貨換算金額は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。  
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。  
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

| 銘柄                           | 株数               | 2017年11月30日現在 |                     | 業種等 |
|------------------------------|------------------|---------------|---------------------|-----|
|                              |                  | 評価額           | 価額                  |     |
|                              |                  | 外貨建金額         | 邦貨換算金額              |     |
| (アメリカ)                       | 千口               | 千アメリカ・ドル      | 千円                  |     |
| POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT | 210.5            | 4,553         | 510,176             |     |
| アメリカ・ドル<br>通貨計               | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 210.5<br>1銘柄  | 4,553<br>< 11.8%>   |     |
| (メキシコ)                       | 千口               | 千メキシコ・ペソ      | 千円                  |     |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA  | 24.5             | 712           | 4,294               |     |
| メキシコ・ペソ<br>通貨計               | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 24.5<br>1銘柄   | 712<br>< 0.1%>      |     |
| (南アフリカ)                      | 千口               | 千南アフリカ・ランド    | 千円                  |     |
| REDEFINE PROPERTIES LTD      | 34.35            | 348           | 2,856               |     |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD   | 27.16            | 677           | 5,556               |     |
| 南アフリカ・ランド<br>通貨計             | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 61.51<br>2銘柄  | 1,025<br>< 0.2%>    |     |
| 合 計                          | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 296.51<br>4銘柄 | 522,883<br>< 12.1%> |     |

(注1) 邦貨換算金額は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。  
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。  
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

# 外国株式インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第18期 (決算日 2017年11月30日)

(計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日)

外国株式インデックスマザーファンドの第18期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                                                                                               |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | 投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。                                                                         |
| 主要投資対象 | 外国の株式（預託証券を含みます。）                                                                                                             |
| 運用方法   | ①主として外国の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。<br>②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。 |
| 株式組入制限 | 無制限                                                                                                                           |

## 大和投資信託

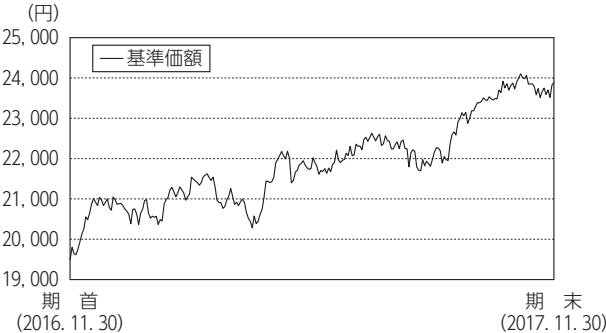
Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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



■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日            | 基準価額   |      | MSC I コクサイ指数 (円ベース) |      | 株 式 組入比率 | 株 式 先物比率 | 投資信託 証券 組入比率 |
|------------------|--------|------|---------------------|------|----------|----------|--------------|
|                  | 円      | 騰落率  | ベンチマーク              | 騰落率  | %        | %        | %            |
| (期首) 2016年11月30日 | 19,489 | —    | 13,848              | —    | 96.0     | 1.4      | 2.5          |
| 12月末             | 20,719 | 6.3  | 14,693              | 6.1  | 96.3     | 0.9      | 2.5          |
| 2017年1月末         | 20,654 | 6.0  | 14,650              | 5.8  | 96.2     | 1.4      | 2.5          |
| 2月末              | 21,054 | 8.0  | 14,923              | 7.8  | 95.9     | 1.6      | 2.6          |
| 3月末              | 21,258 | 9.1  | 15,035              | 8.6  | 96.1     | 1.2      | 2.6          |
| 4月末              | 21,407 | 9.8  | 15,090              | 9.0  | 96.3     | 1.0      | 2.6          |
| 5月末              | 21,733 | 11.5 | 15,266              | 10.2 | 95.9     | 1.6      | 2.5          |
| 6月末              | 22,074 | 13.3 | 15,472              | 11.7 | 95.9     | 1.5      | 2.5          |
| 7月末              | 22,241 | 14.1 | 15,582              | 12.5 | 95.8     | 1.7      | 2.6          |
| 8月末              | 22,159 | 13.7 | 15,489              | 11.8 | 95.2     | 2.1      | 2.7          |
| 9月末              | 23,190 | 19.0 | 16,180              | 16.8 | 96.3     | 1.2      | 2.6          |
| 10月末             | 23,726 | 21.7 | 16,536              | 19.4 | 95.8     | 1.6      | 2.6          |
| (期末) 2017年11月30日 | 23,891 | 22.6 | 16,622              | 20.0 | 95.5     | 1.8      | 2.6          |

(注 1) 騰落率は期首比。  
(注 2) MSC I コクサイ指数 (円ベース) は、MSC I Inc. の承諾を得て、MSC I コクサイ指数 (米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSC I コクサイ指数 (米ドルベース) は、MSC I Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSC I Inc. に帰属します。またMSC I Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。  
(注 3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。  
(注 4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】  
期首：19,489円 期末：23,891円 騰落率：22.6%  
【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク (MSC I コクサイ指数 (円ベース) ) の動きをほぼ反映して、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は、米国トランプ政権の政策への期待などから期首より堅調なスタートとなり、2017年1月以降も、トランプ大統領が石油パイプラインの建設を前進させる大統領令に署名したことや、大型減税を唆したことにより景気拡大への期待が高まったことなどを背景に、上昇基調は継続しました。4月以降は、朝鮮半島の緊迫化など地政学リスクへの警戒感を背景に神経質な展開となりましたが、フランス大統領選挙の結果が世論調査通りとなったことを受けて上昇し、その後も米国長期金利の上昇一服など良好な投資環境から堅調に推移しました。8月に入ると、北朝鮮に係る地政学リスクへの警戒が再燃したことや、スペインでのテロ事件などから軟調な展開となりましたが、ECB (欧州中央銀行) が2017年のEU (欧州連合) 圏の成長率見通しを引き上げたこと、トランプ政権が税制改革案を公表したことなどを支援材料として上昇し、期を通じては上昇して期末を迎えました。

○為替相場

為替相場は、期を通じてユーロなどの欧州の通貨が対円で上昇しました。期首より、米国の利上げ観測などを受けて円安となりましたが、2017年に入ると、トランプ政権に対する期待感の後退や欧州の政治情勢の不透明感などから円高傾向となりました。4月半ばからは、フランス大統領選挙の結果などを受けて、ユーロが上昇傾向となった一方で円は下落傾向となりました。5月にはいったん円高となる場面も見られましたが、6月中旬に入り先進各国の中央銀行が金融緩和姿勢を後退させる中で内外の金利差が拡大傾向となったことから、円は下落傾向となりました。7月以降は、地政学リスクの高まりなどから円高傾向となりました。9月以降は、米国の2017年中の追加利上げ観測の高まりなどを背景に円安が進み、米国の低インフレへの懸念などから円高に転じました。

◆前期における「今後の運用方針」

今後の運用にあたりましても、引き続き、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なってまいります。

◆ポートフォリオについて

外国株式を中心に、S & P 500先物取引も一部利用し、株式組入比率 (投資信託証券、株式先物を含む。) につきましては、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

ベンチマーク (MSC I コクサイ指数 (円ベース) ) の騰落率は20.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は22.6%となりました。  
ファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、かい離要因となりました。  
その他、ファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、売買手数料・保管費用等のコスト負担がかい離要因としてあげられます。

《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なってまいります。



■ 1 万口当りの費用の明細

| 項 目      | 当 期   |
|----------|-------|
| 売買委託手数料  | 1円    |
| (株式)     | ( 1)  |
| (先物)     | ( 0)  |
| (投資信託証券) | ( 0)  |
| 有価証券取引税  | 1     |
| (株式)     | ( 1)  |
| (投資信託証券) | ( 0)  |
| その他費用    | 12    |
| (保管費用)   | ( 12) |
| (その他)    | ( 0)  |
| 合 計      | 14    |

(注 1) 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、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注 2) 各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

(2016年12月 1 日から2017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<br>3, 341. 7<br>( 253. 89)     | 千アメリカ・ドル<br>22, 389<br>(△ 3, 456)   | 百株<br>4, 430. 91 | 千アメリカ・ドル<br>24, 071   |
|   | カナダ      | 百株<br>607<br>( 11. 11)            | 千カナダ・ドル<br>2, 885<br>( — )          | 百株<br>483. 78    | 千カナダ・ドル<br>1, 615     |
|   | オーストラリア  | 百株<br>740. 5<br>(△ 1, 811. 25)    | 千オーストラリア・ドル<br>1, 299<br>(△ 1, 196) | 百株<br>907        | 千オーストラリア・ドル<br>1, 128 |
|   | 香港       | 百株<br>1, 952<br>(△ 28. 42)        | 千香港ドル<br>2, 314<br>(△ 879)          | 百株<br>1, 665. 06 | 千香港ドル<br>3, 294       |
|   | シンガポール   | 百株<br>602<br>( — )                | 千シンガポール・ドル<br>190<br>( — )          | 百株<br>877        | 千シンガポール・ドル<br>172     |
|   | ニュージーランド | 百株<br>35<br>( — )                 | 千ニュージーランド・ドル<br>29<br>( — )         | 百株<br>—          | 千ニュージーランド・ドル<br>—     |
|   | イギリス     | 百株<br>5, 229. 5<br>(△ 2, 434. 83) | 千イギリス・ポンド<br>2, 998<br>(△ 31)       | 百株<br>2, 972. 1  | 千イギリス・ポンド<br>1, 962   |
|   | イスラエル    | 百株<br>45<br>( — )                 | 千イスラエル・シェケル<br>609<br>( — )         | 百株<br>146        | 千イスラエル・シェケル<br>235    |
|   | スイス      | 百株<br>265<br>( 30. 6)             | 千スイス・フラン<br>1, 365<br>(△ 196)       | 百株<br>210. 96    | 千スイス・フラン<br>2, 709    |

|   |                  | 買 付                                |                                  | 売 付              |                        |
|---|------------------|------------------------------------|----------------------------------|------------------|------------------------|
|   |                  | 株 数                                | 金 額                              | 株 数              | 金 額                    |
| 外 | デンマーク            | 百株<br>119<br>( — )                 | 千デンマーク・クローネ<br>3, 015<br>( — )   | 百株<br>50. 7      | 千デンマーク・クローネ<br>1, 613  |
|   | ノルウェー            | 百株<br>45<br>( — )                  | 千ノルウェー・クローネ<br>671<br>(△ 115)    | 百株<br>60         | 千ノルウェー・クローネ<br>599     |
|   | スウェーデン           | 百株<br>230<br>( 155)                | 千スウェーデン・クローネ<br>3, 578<br>(△ 11) | 百株<br>393. 5     | 千スウェーデン・クローネ<br>4, 178 |
|   | ユーロ<br>(アイルランド)  | 百株<br>(△ 6, 397. 4)                | 千ユーロ<br>—<br>( — )               | 百株<br>—          | 千ユーロ<br>—              |
|   | ユーロ<br>(オランダ)    | 百株<br>202<br>(△ 2. 02)             | 千ユーロ<br>537<br>(△ 7)             | 百株<br>118. 8     | 千ユーロ<br>343            |
|   | ユーロ<br>(ベルギー)    | 百株<br>11. 8<br>( 22. 5)            | 千ユーロ<br>104<br>( — )             | 百株<br>19. 2      | 千ユーロ<br>131            |
|   | ユーロ<br>(ルクセンブルグ) | 百株<br>24. 7<br>(△ 282)             | 千ユーロ<br>149<br>( — )             | 百株<br>—          | 千ユーロ<br>—              |
|   | ユーロ<br>(フランス)    | 百株<br>398. 9<br>(△ 16. 05)         | 千ユーロ<br>1, 594<br>(△ 32)         | 百株<br>180. 4     | 千ユーロ<br>1, 360         |
|   | ユーロ<br>(ドイツ)     | 百株<br>450. 5<br>( 362. 5)          | 千ユーロ<br>1, 495<br>(△ 45)         | 百株<br>546. 9     | 千ユーロ<br>1, 120         |
|   | ユーロ<br>(ポルトガル)   | 百株<br>13<br>( — )                  | 千ユーロ<br>17<br>( — )              | 百株<br>—          | 千ユーロ<br>—              |
| 国 | ユーロ<br>(スペイン)    | 百株<br>987<br>(△ 1, 561. 17)        | 千ユーロ<br>726<br>(△ 27)            | 百株<br>1, 271. 23 | 千ユーロ<br>337            |
|   | ユーロ<br>(イタリア)    | 百株<br>1, 265<br>(△ 2, 185. 15)     | 千ユーロ<br>905<br>(△ 25)            | 百株<br>751. 68    | 千ユーロ<br>407            |
|   | ユーロ<br>(フィンランド)  | 百株<br>139. 5<br>( — )              | 千ユーロ<br>118<br>( — )             | 百株<br>115        | 千ユーロ<br>113            |
|   | ユーロ<br>(オーストリア)  | 百株<br>10<br>( — )                  | 千ユーロ<br>27<br>(△ 6)              | 百株<br>—          | 千ユーロ<br>—              |
|   | ユーロ<br>(その他)     | 百株<br>—<br>( 51)                   | 千ユーロ<br>—<br>( — )               | 百株<br>58         | 千ユーロ<br>174            |
|   | ユーロ<br>(ユーロ通貨計)  | 百株<br>3, 502. 4<br>(△ 10, 007. 79) | 千ユーロ<br>5, 677<br>(△ 144)        | 百株<br>3, 061. 21 | 千ユーロ<br>3, 989         |

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

(2) 投資信託証券

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

|   |               | 買 付                     |                               | 売 付                  |                           |
|---|---------------|-------------------------|-------------------------------|----------------------|---------------------------|
|   |               | 口 数                     | 金 額                           | 口 数                  | 金 額                       |
| 外 | アメリカ          | 千口<br>33.77<br>( 7.103) | 千アメリカ・ドル<br>1,614<br>( 339)   | 千口<br>11.573<br>( ー) | 千アメリカ・ドル<br>697<br>( ー)   |
|   | カナダ           | 千口<br>0.6<br>( ー)       | 千カナダ・ドル<br>14<br>( ー)         | 千口<br>ー<br>( ー)      | 千カナダ・ドル<br>ー<br>( ー)      |
|   | オーストラリア       | 千口<br>24.5<br>112.9)    | 千オーストラリア・ドル<br>95<br>( 1,052) | 千口<br>25.1<br>( ー)   | 千オーストラリア・ドル<br>78<br>( ー) |
|   | 香港            | 千口<br>64.5<br>87)       | 千香港ドル<br>462<br>( 879)        | 千口<br>ー<br>( ー)      | 千香港ドル<br>ー<br>( ー)        |
|   | シンガポール        | 千口<br>69.5<br>( ー)      | 千シンガポール・ドル<br>119<br>(△ 3)    | 千口<br>ー<br>( ー)      | 千シンガポール・ドル<br>ー<br>( ー)   |
| 国 | イギリス          | 千口<br>5.6<br>(△ 1.138)  | 千イギリス・ポンド<br>27<br>(△ 14)     | 千口<br>ー<br>( ー)      | 千イギリス・ポンド<br>ー<br>( ー)    |
|   | ユーロ<br>(フランス) | 千口<br>0.43<br>( ー)      | 千ユーロ<br>53<br>(△ 3)           | 千口<br>0.09<br>( ー)   | 千ユーロ<br>19<br>( ー)        |

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

■主要な売買銘柄  
株 式

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

| 当 期                                 |            |              |            | 期 付                                |            |               |            |
|-------------------------------------|------------|--------------|------------|------------------------------------|------------|---------------|------------|
| 買 付                                 |            | 売            |            | 買 付                                |            | 売             |            |
| 銘 柄                                 | 株 数        | 金 額          | 平均単価       | 銘 柄                                | 株 数        | 金 額           | 平均単価       |
| ENBRIDGE INC (カナダ)                  | 千株<br>17.2 | 千円<br>79,833 | 円<br>4,641 | YAHOO! INC (アメリカ)                  | 千株<br>21.7 | 千円<br>125,430 | 円<br>5,780 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC (イギリス) | 11.1       | 79,216       | 7,136      | SYNGENTA AG-REG (スイス)              | 2.162      | 111,908       | 51,761     |
| FACEBOOK INC-A (アメリカ)               | 3.45       | 59,454       | 17,233     | APPLE INC (アメリカ)                   | 6.4        | 96,686        | 15,107     |
| EXXON MOBIL CORP (アメリカ)             | 6.6        | 59,132       | 8,959      | BRITISH AMERICAN TOB-SP ADR (イギリス) | 10.245     | 73,700        | 7,193      |
| UNICREDIT SPA (イタリア)                | 36.4       | 56,538       | 1,553      | ENBRIDGE INC (カナダ)                 | 15.74      | 73,158        | 4,647      |
| AMAZON.COM INC (アメリカ)               | 0.51       | 53,551       | 105,002    | ACTELION LTD-REG (スイス)             | 2.25       | 71,670        | 31,853     |
| ALPHABET INC-CL C (アメリカ)            | 0.38       | 38,183       | 100,482    | MICROSOFT CORP (アメリカ)              | 6.2        | 46,853        | 7,557      |
| BANCO SANTANDER SA (スペイン)           | 50.1       | 37,672       | 751        | EXXON MOBIL CORP (アメリカ)            | 4.8        | 46,567        | 9,701      |
| ALPHABET INC-CL A (アメリカ)            | 0.36       | 37,076       | 102,990    | AMAZON.COM INC (アメリカ)              | 0.42       | 42,468        | 101,115    |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL (イギリス)    | 10         | 36,444       | 3,644      | ALLERGAN PLC (アイルランド)              | 1.6        | 41,883        | 26,176     |

(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

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

| 種 類 別 |        | 買 建          |              | 売 建      |          |
|-------|--------|--------------|--------------|----------|----------|
|       |        | 新規買付額        | 決 済 額        | 新規売付額    | 決 済 額    |
| 外国    | 株式先物取引 | 百万円<br>9,535 | 百万円<br>9,134 | 百万円<br>ー | 百万円<br>ー |
|       |        |              |              |          |          |

(注 1) 金額は受渡し代金。  
(注 2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

## (1) 外国株式

| 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      |            |
| (アメリカ)                        |   |        |        |          |         |            |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION |   | 27     | 27     | 240      | 26,961  | 情報技術       |
| PALO ALTO NETWORKS INC        |   | 21     | 21     | 304      | 34,095  | 情報技術       |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC      |   | 14.5   | 13.5   | 186      | 20,855  | ヘルスケア      |
| SYNCHRONY FINANCIAL           |   | 196    | 188    | 664      | 74,466  | 金融         |
| ABBOTT LABORATORIES           |   | 341    | 396.16 | 2,201    | 246,718 | ヘルスケア      |
| ARCONIC INC                   |   | 103.33 | 89.33  | 215      | 24,092  | 資本財・サービス   |
| VERISK ANALYTICS INC          |   | 37.5   | 35     | 332      | 37,248  | 資本財・サービス   |
| LAS VEGAS SANDS CORP          |   | 101    | 92     | 621      | 69,644  | 一般消費財・サービス |
| AMPHENOL CORP-CL A            |   | 72     | 69.5   | 623      | 69,908  | 情報技術       |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV   |   | 71.79  | 75.79  | 702      | 78,740  | 情報技術       |
| QORVO INC                     |   | 32     | 29     | 222      | 24,920  | 情報技術       |
| AFLAC INC                     |   | 97     | 92     | 802      | 89,880  | 金融         |
| DARDEN RESTAURANTS INC        |   | 27.5   | 27.5   | 233      | 26,133  | 一般消費財・サービス |
| ADOBE SYSTEMS INC             |   | 114.5  | 113.5  | 2,007    | 224,912 | 情報技術       |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC    |   | 50     | 55     | 202      | 22,709  | 素材         |
| LULULEMON ATHLETICA INC       |   | 25     | 25     | 167      | 18,731  | 一般消費財・サービス |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL     |   | 68     | 80     | 154      | 17,264  | 金融         |
| GARMIN LTD                    |   | 26     | 29     | 180      | 20,276  | 一般消費財・サービス |
| AETNA INC                     |   | 80.79  | 75.79  | 1,360    | 152,495 | ヘルスケア      |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC  |   | 47.5   | 50.5   | 821      | 92,018  | 素材         |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC   |   | 166    | 165    | 2,528    | 283,313 | 資本財・サービス   |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC     |   | 37.51  | 37.51  | 271      | 30,400  | 情報技術       |
| WR BERKLEY CORP               |   | 21     | 23     | 157      | 17,653  | 金融         |
| AUTOZONE INC                  |   | 6.7    | 6.3    | 434      | 48,631  | 一般消費財・サービス |
| DOLLAR TREE INC               |   | 55.71  | 53.21  | 554      | 62,090  | 一般消費財・サービス |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR    |   | 209    | 209    | 314      | 35,291  | ヘルスケア      |
| PINNACLE WEST CAPITAL         |   | 26.5   | 26.5   | 241      | 27,023  | 公益事業       |
| CELANESE CORP-SERIES A        |   | 33     | 33     | 352      | 39,520  | 素材         |
| DR HORTON INC                 |   | 79.66  | 83.16  | 421      | 47,205  | 一般消費財・サービス |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK  |   | 21     | 21     | 96       | 10,835  | エネルギー      |
| DENTSPLY SIRONA INC           |   | 55     | 52     | 355      | 39,830  | ヘルスケア      |
| AUTODESK INC                  |   | 45.5   | 45.5   | 497      | 55,744  | 情報技術       |
| MOODY'S CORP                  |   | 40.5   | 40     | 599      | 67,158  | 金融         |
| DEVON ENERGY CORP             |   | 109    | 117.5  | 435      | 48,845  | エネルギー      |
| ALBEMARLE CORP                |   | 26     | 26     | 343      | 38,440  | 素材         |
| ATMOS ENERGY CORP             |   | 23     | 25     | 226      | 25,354  | 公益事業       |
| ALLIANT ENERGY CORP           |   | 50     | 54     | 242      | 27,167  | 公益事業       |
| CITIGROUP INC                 |   | 661.23 | 628.23 | 4,714    | 528,230 | 金融         |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING     |   | 106    | 103    | 1,167    | 130,795 | 情報技術       |
| AMERICAN ELECTRIC POWER       |   | 115    | 114    | 879      | 98,536  | 公益事業       |
| ALLEGHANY CORP                |   | 3.5    | 3.5    | 204      | 22,912  | 金融         |
| DUN & BRADSTREET CORP         |   | 9      | —      | —        | —       | 資本財・サービス   |
| DOMINO'S PIZZA INC            |   | 11     | 11     | 197      | 22,083  | 一般消費財・サービス |
| HESS CORP                     |   | 65     | 65     | 291      | 32,636  | エネルギー      |
| DAVITA INC                    |   | 38     | 35     | 212      | 23,781  | ヘルスケア      |
| DANAHER CORP                  |   | 142.5  | 142    | 1,333    | 149,468 | ヘルスケア      |
| FORTIVE CORP                  |   | 72     | 72     | 528      | 59,232  | 資本財・サービス   |
| AVNET INC                     |   | 28     | 28     | 115      | 12,938  | 情報技術       |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN  |   | 135    | 135    | 942      | 105,584 | 金融         |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A      |   | 40     | 40     | 54       | 6,082   | 一般消費財・サービス |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘                            | 柄 | 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        |            |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C     |   | 40.28  | 40.28  |          | 5,497     | 一般消費財・サービス |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    |   | 134    | 129    | 513      | 57,485    | 生活必需品      |
| BUNGE LTD                    |   | 31     | 31     | 205      | 23,071    | 生活必需品      |
| TE CONNECTIVITY LTD          |   | 82.25  | 82.25  | 775      | 86,861    | 情報技術       |
| APPLE INC                    |   | 1,239  | 1,189  | 20,151   | 2,257,938 | 情報技術       |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  |   | 94     | 86     | 593      | 66,500    | 金融         |
| BOEING CO/THE                |   | 135    | 130.5  | 3,514    | 393,784   | 資本財・サービス   |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    |   | 34.65  | 34.65  | 259      | 29,068    | 金融         |
| SPECTRA ENERGY CORP          |   | 159.96 | —      | —        | —         | その他        |
| BECTON DICKINSON AND CO      |   | 48.87  | 51.87  | 1,176    | 131,863   | ヘルスケア      |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR   |   | —      | 60     | 155      | 17,378    | 一般消費財・サービス |
| LEIDOS HOLDINGS INC          |   | —      | 33     | 205      | 23,069    | 情報技術       |
| CDK GLOBAL INC               |   | 29     | 29     | 200      | 22,424    | 情報技術       |
| NISOURCE INC                 |   | 73     | 73     | 198      | 22,224    | 公益事業       |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC |   | 33.5   | 33.5   | 283      | 31,714    | 資本財・サービス   |
| CR BARD INC                  |   | 16.8   | 16.8   | 565      | 63,402    | ヘルスケア      |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP |   | 250.71 | 236.71 | 1,287    | 144,313   | 金融         |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   |   | 936.04 | 934.04 | 4,660    | 522,249   | 電気通信サービス   |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  |   | 275.5  | 285.5  | 5,420    | 607,335   | 金融         |
| ANSYS INC                    |   | 21     | 19     | 278      | 31,206    | 情報技術       |
| H&R BLOCK INC                |   | 51     | 51     | 131      | 14,783    | 一般消費財・サービス |
| BB&T CORP                    |   | 190    | 187.5  | 921      | 103,198   | 金融         |
| BAKER HUGHES INC             |   | 95.73  | —      | —        | —         | その他        |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      |   | 387    | 378.5  | 2,380    | 266,764   | ヘルスケア      |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO    |   | 13     | —      | —        | —         | 生活必需品      |
| JPMORGAN CHASE & CO          |   | 826.7  | 813.2  | 8,435    | 945,178   | 金融         |
| T ROWE PRICE GROUP INC       |   | 56     | 56     | 567      | 63,544    | 金融         |
| CIGNA CORP                   |   | 59     | 59     | 1,214    | 136,073   | ヘルスケア      |
| LKQ CORP                     |   | 68     | 72     | 284      | 31,867    | 一般消費財・サービス |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD   |   | 10     | 10     | 136      | 15,288    | 金融         |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP |   | 258.42 | —      | —        | —         | 電気通信サービス   |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    |   | 50     | 45.5   | 269      | 30,181    | 生活必需品      |
| CADENCE DESIGN SYS INC       |   | 69     | 64     | 276      | 30,950    | 情報技術       |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     |   | 39.6   | 34.6   | 565      | 63,411    | 金融         |
| DOLLAR GENERAL CORP          |   | 65     | 62     | 549      | 61,606    | 一般消費財・サービス |
| SERVICENOW INC               |   | 38     | 39.5   | 476      | 53,372    | 情報技術       |
| CATERPILLAR INC              |   | 134    | 135    | 1,863    | 208,839   | 資本財・サービス   |
| CMS ENERGY CORP              |   | 64     | 64     | 317      | 35,576    | 公益事業       |
| MOSAIC CO/THE                |   | 75.5   | 75.5   | 184      | 20,633    | 素材         |
| DELTA AIR LINES INC          |   | 44     | 44     | 229      | 25,686    | 資本財・サービス   |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO    |   | 43.5   | —      | —        | —         | その他        |
| CORNING INC                  |   | 247    | 213    | 691      | 77,518    | 情報技術       |
| CISCO SYSTEMS INC            |   | 1,159  | 1,141  | 4,276    | 479,178   | 情報技術       |
| DU PONT (E. I.) DE NEMOURS   |   | 200    | —      | —        | —         | その他        |
| MORGAN STANLEY               |   | 333    | 318    | 1,631    | 182,862   | 金融         |
| WABCO HOLDINGS INC           |   | 12.5   | 12.5   | 187      | 20,985    | 資本財・サービス   |
| DOW CHEMICAL CO/THE          |   | 258    | —      | —        | —         | その他        |
| MSCI INC                     |   | 22     | 21.5   | 274      | 30,771    | 金融         |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     |   | —      | 9      | 183      | 20,555    | 資本財・サービス   |
| MIDDLEBY CORP                |   | —      | 13     | 162      | 18,254    | 資本財・サービス   |
| COTY INC-CL A                |   | 111.39 | 111.39 | 190      | 21,330    | 生活必需品      |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   |   | —      | 41     | 168      | 18,831    | 情報技術       |
| BROADCOM LTD                 |   | 90.62  | 91.52  | 2,484    | 278,418   | 情報技術       |

| 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       |            |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     |   | 10. 5   | 10. 5   | 135      | 15, 191  | ヘルスケア      |
| DICK'S SPORTING GOODS INC    |   | 20      | 20      | 58       | 6, 601   | 一般消費財・サービス |
| ACUITY BRANDS INC            |   | 10      | 10      | 170      | 19, 098  | 資本財・サービス   |
| ARAMARK                      |   | 53. 5   | 58. 5   | 249      | 27, 910  | 一般消費財・サービス |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   |   | 49      | 49      | 183      | 20, 616  | 素材         |
| DTE ENERGY COMPANY           |   | 42      | 41. 5   | 475      | 53, 271  | 公益事業       |
| CENTENE CORP                 |   | 40      | 40      | 396      | 44, 376  | ヘルスケア      |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      |   | —       | 24      | 290      | 32, 520  | 金融         |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     |   | 122     | 116     | 471      | 52, 862  | 金融         |
| ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS |   | 43      | —       | —        | —        | その他        |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      |   | 40. 5   | 40. 5   | 269      | 30, 141  | 金融         |
| GARTNER INC                  |   | 19      | 21      | 250      | 28, 074  | 情報技術       |
| SPLUNK INC                   |   | 29      | 32      | 254      | 28, 501  | 情報技術       |
| WHITEWAVE FOODS CO           |   | 41      | —       | —        | —        | その他        |
| AGCO CORP                    |   | 17      | 14. 5   | 102      | 11, 519  | 資本財・サービス   |
| DOMINION ENERGY INC          |   | 143     | 143     | 1, 201   | 134, 594 | 公益事業       |
| MONSTER BEVERAGE CORP        |   | 93      | 93      | 575      | 64, 493  | 生活必需品      |
| SMITH (A. O. ) CORP          |   | 34      | 34      | 212      | 23, 810  | 資本財・サービス   |
| DEERE & CO                   |   | 62      | 61. 5   | 912      | 102, 291 | 資本財・サービス   |
| GLOBAL PAYMENTS INC          |   | 36      | 36      | 356      | 39, 918  | 情報技術       |
| TIME WARNER INC              |   | 176. 33 | 176. 33 | 1, 603   | 179, 637 | 一般消費財・サービス |
| VMWARE INC-CLASS A           |   | 19      | 16. 5   | 197      | 22, 078  | 情報技術       |
| TEGNA INC                    |   | 45      | —       | —        | —        | 一般消費財・サービス |
| NASDAQ INC                   |   | 27      | 27      | 212      | 23, 767  | 金融         |
| VAIL RESORTS INC             |   | —       | 9. 5    | 212      | 23, 826  | 一般消費財・サービス |
| EAST WEST BANCORP INC        |   | —       | 34      | 209      | 23, 452  | 金融         |
| TARGA RESOURCES CORP         |   | —       | 50. 5   | 210      | 23, 613  | エネルギー      |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA |   | —       | 15      | 246      | 27, 592  | 金融         |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC |   | —       | 18      | 189      | 21, 231  | 金融         |
| CONSOLIDATED EDISON INC      |   | 70      | 70      | 618      | 69, 336  | 公益事業       |
| MEDNAX INC                   |   | 20      | 22      | 110      | 12, 369  | ヘルスケア      |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP       |   | 26      | 24      | 269      | 30, 191  | 一般消費財・サービス |
| TELEFLEX INC                 |   | —       | 10      | 264      | 29, 627  | ヘルスケア      |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  |   | 21      | 21      | 228      | 25, 563  | 資本財・サービス   |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    |   | —       | 25      | 147      | 16, 493  | ヘルスケア      |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR |   | —       | 17. 5   | 115      | 12, 914  | 資本財・サービス   |
| IDEX CORP                    |   | —       | 18      | 238      | 26, 723  | 資本財・サービス   |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         |   | 194. 5  | 191. 5  | 1, 378   | 154, 515 | 生活必需品      |
| ROLLINS INC                  |   | —       | 22      | 101      | 11, 366  | 資本財・サービス   |
| AMETEK INC                   |   | 52. 25  | 52. 25  | 374      | 41, 965  | 資本財・サービス   |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       |   | 58      | 58      | 271      | 30, 408  | 生活必需品      |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  |   | —       | 32      | 133      | 14, 969  | 資本財・サービス   |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     |   | 84      | 79. 5   | 834      | 93, 542  | 素材         |
| COSTCO WHOLESALE CORP        |   | 101. 5  | 100. 5  | 1, 784   | 199, 916 | 生活必需品      |
| SCANA CORP                   |   | 31      | 31      | 135      | 15, 193  | 公益事業       |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    |   | 12      | 13. 5   | 268      | 30, 046  | 金融         |
| WR GRACE & CO                |   | 16      | 16      | 118      | 13, 230  | 素材         |
| VALSPAR CORP/THE             |   | 17      | —       | —        | —        | その他        |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   |   | 7       | 6       | 181      | 20, 302  | 一般消費財・サービス |
| LEUCADIA NATIONAL CORP       |   | 76      | 76      | 202      | 22, 677  | 金融         |
| UGI CORP                     |   | 39      | 39      | 187      | 20, 971  | 公益事業       |
| CUMMINS INC                  |   | 37      | 37      | 608      | 68, 207  | 資本財・サービス   |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      |   | 136     | 163     | 1, 010   | 113, 255 | 情報技術       |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 株 数    | 株 数    | 期 末      |           | 業 種 等      |
|------------------------------|--------|--------|----------|-----------|------------|
|                              |        |        | 評 価 額    |           |            |
|                              |        |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| 百株                           |        | 百株     | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| SABRE CORP                   | 46     | 46     | 91       | 10,215    | 情報技術       |
| CDW CORP/DE                  | 35.5   | 37.5   | 258      | 28,955    | 情報技術       |
| SIGNATURE BANK               | 13     | 13     | 180      | 20,208    | 金融         |
| COSTAR GROUP INC             | —      | 8.5    | 256      | 28,749    | 情報技術       |
| SVB FINANCIAL GROUP          | —      | 12     | 272      | 30,519    | 金融         |
| AMERCO                       | 1.7    | 1.7    | 62       | 7,001     | 資本財・サービス   |
| MERCADOLIBRE INC             | —      | 10     | 267      | 29,995    | 情報技術       |
| HANESBRANDS INC              | 85     | 85     | 172      | 19,343    | 一般消費財・サービス |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC  | —      | 18     | 205      | 22,972    | 情報技術       |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 122    | 45.66  | 349      | 39,169    | 一般消費財・サービス |
| COMMSCOPE HOLDING CO INC     | —      | 46     | 167      | 18,782    | 情報技術       |
| DEXCOM INC                   | —      | 19     | 112      | 12,641    | ヘルスケア      |
| DIAMONDBACK ENERGY INC       | —      | 20.5   | 221      | 24,842    | エネルギー      |
| SEATTLE GENETICS INC         | —      | 22.5   | 133      | 14,909    | ヘルスケア      |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | —      | 17.7   | 457      | 51,242    | ヘルスケア      |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 12     | 12     | 335      | 37,557    | 資本財・サービス   |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | 29.5   | —      | —        | —         | 不動産        |
| NIELSEN HOLDINGS PLC         | 85     | 80     | 290      | 32,557    | 資本財・サービス   |
| KINDER MORGAN INC            | 439.81 | 460.81 | 772      | 86,538    | エネルギー      |
| HCA HEALTHCARE INC           | 71     | 68     | 544      | 61,061    | ヘルスケア      |
| CABOT OIL & GAS CORP         | 105.5  | 105.5  | 307      | 34,482    | エネルギー      |
| T-MOBILE US INC              | 67.5   | 68.5   | 423      | 47,457    | 電気通信サービス   |
| ZILLOW GROUP INC - C         | 25     | 25     | 102      | 11,448    | 情報技術       |
| COCA-COLA CO/THE             | 946.5  | 929.5  | 4,229    | 473,884   | 生活必需品      |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 40     | 40     | 257      | 28,868    | 資本財・サービス   |
| EATON VANCE CORP             | 25     | 25     | 136      | 15,303    | 金融         |
| FMC TECHNOLOGIES INC         | 49     | —      | —        | —         | その他        |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 87     | 76     | 327      | 36,728    | 金融         |
| CSX CORP                     | 222    | 209.5  | 1,140    | 127,795   | 資本財・サービス   |
| FLUOR CORP                   | 33     | 33     | 159      | 17,822    | 資本財・サービス   |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 23.5   | 23.5   | 368      | 41,346    | ヘルスケア      |
| EXPEDIA INC                  | 28.75  | 28.75  | 350      | 39,307    | 一般消費財・サービス |
| AUTOLIV INC                  | 20     | 20     | 253      | 28,420    | 一般消費財・サービス |
| AMAZON.COM INC               | 92.1   | 93     | 10,799   | 1,210,118 | 一般消費財・サービス |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A   | —      | 50     | 131      | 14,768    | エネルギー      |
| FLOWSERVE CORP               | 29     | 29     | 120      | 13,488    | 資本財・サービス   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 49     | 49     | 570      | 63,892    | ヘルスケア      |
| EXXON MOBIL CORP             | 953.05 | 971.05 | 7,988    | 895,148   | エネルギー      |
| FLIR SYSTEMS INC             | 31     | 31     | 144      | 16,172    | 情報技術       |
| AES CORP                     | 156    | 156    | 165      | 18,546    | 公益事業       |
| L3 TECHNOLOGIES INC          | 18     | 18     | 353      | 39,622    | 資本財・サービス   |
| EVEREST RE GROUP LTD         | 10     | 9      | 200      | 22,462    | 金融         |
| EOG RESOURCES INC            | 126.5  | 132.5  | 1,331    | 149,208   | エネルギー      |
| EQT CORP                     | 40.5   | 40.5   | 235      | 26,370    | エネルギー      |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 42     | 39     | 215      | 24,183    | 情報技術       |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 44     | 38     | 321      | 36,047    | ヘルスケア      |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 77.9   | 72.9   | 500      | 56,109    | ヘルスケア      |
| FORD MOTOR CO                | 851.23 | 853.23 | 1,071    | 120,079   | 一般消費財・サービス |
| TESARO INC                   | —      | 9      | 74       | 8,375     | ヘルスケア      |
| MACY'S INC                   | 73.98  | 68.98  | 165      | 18,534    | 一般消費財・サービス |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A   | 34.4   | 34.4   | 64       | 7,273     | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         | 62.87  | 48.87  | 157      | 17,676    | 一般消費財・サービス |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C   | 58.2   | 51.2   | 91       | 10,200    | 一般消費財・サービス |

| 銘                            | 柄 | 期 首    | 当      | 期 末      |         | 業 種 等      |
|------------------------------|---|--------|--------|----------|---------|------------|
|                              |   | 株 数    | 株 数    | 評 価 額    |         |            |
|                              |   |        |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
|                              |   | 百株     | 百株     | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| MOBILEYE NV                  |   | 39     | —      | —        | —       | その他        |
| TARO PHARMACEUTICAL INDUS    |   | 3      | 3      | 33       | 3,703   | ヘルスケア      |
| AERCAP HOLDINGS NV           |   | 38     | 38     | 196      | 22,030  | 資本財・サービス   |
| FORTINET INC                 |   | 31     | 35     | 145      | 16,251  | 情報技術       |
| MARKEL CORP                  |   | 3.2    | 3.2    | 353      | 39,575  | 金融         |
| NEXTERA ENERGY INC           |   | 105.5  | 107    | 1,688    | 189,155 | 公益事業       |
| FREEPORT-MCMORAN INC         |   | 271.08 | 318.08 | 445      | 49,932  | 素材         |
| US BANCORP                   |   | 395    | 387    | 2,119    | 237,457 | 金融         |
| UNITED RENTALS INC           |   | 22     | 19     | 299      | 33,603  | 資本財・サービス   |
| F5 NETWORKS INC              |   | 16     | 14.5   | 188      | 21,098  | 情報技術       |
| FASTENAL CO                  |   | 65     | 65     | 333      | 37,319  | 資本財・サービス   |
| FISERV INC                   |   | 52     | 49.5   | 637      | 71,394  | 情報技術       |
| GENERAL ELECTRIC CO          |   | 2,056  | 1,991  | 3,679    | 412,273 | 資本財・サービス   |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN |   | 36.5   | 43.5   | 240      | 26,949  | 一般消費財・サービス |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO    |   | 61.5   | 56.5   | 181      | 20,347  | 一般消費財・サービス |
| GENERAL MOTORS CO            |   | 319    | 311    | 1,362    | 152,667 | 一般消費財・サービス |
| TRIPADVISOR INC              |   | 27.5   | 27.5   | 95       | 10,652  | 一般消費財・サービス |
| LINKEDIN CORP - A            |   | 26     | —      | —        | —       | その他        |
| GENERAL DYNAMICS CORP        |   | 60.5   | 59     | 1,204    | 134,975 | 資本財・サービス   |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      |   | 83     | 81.6   | 1,969    | 220,682 | 金融         |
| ALPHABET INC-CL A            |   | 67.6   | 68.1   | 7,064    | 791,583 | 情報技術       |
| ALPHABET INC-CL C            |   | 70.97  | 71.47  | 7,301    | 818,167 | 情報技術       |
| GENERAL MILLS INC            |   | 136    | 130    | 732      | 82,067  | 生活必需品      |
| FIRSTENERGY CORP             |   | 99.68  | 99.68  | 335      | 37,606  | 公益事業       |
| GENUINE PARTS CO             |   | 35     | 35     | 320      | 35,884  | 一般消費財・サービス |
| IHS MARKIT LTD               |   | 82.34  | 95.34  | 421      | 47,175  | 資本財・サービス   |
| FIFTH THIRD BANCORP          |   | 175    | 175    | 533      | 59,728  | 金融         |
| HARRIS CORP                  |   | 29.5   | 27.5   | 393      | 44,131  | 情報技術       |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC  |   | 30     | 30     | 147      | 16,555  | 資本財・サービス   |
| HALLIBURTON CO               |   | 197.5  | 198.5  | 819      | 91,859  | エネルギー      |
| HOME DEPOT INC               |   | 281.5  | 273.5  | 4,847    | 543,194 | 一般消費財・サービス |
| ASSURANT INC                 |   | 14     | 12.5   | 127      | 14,245  | 金融         |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    |   | 246    | 246    | 356      | 39,913  | 金融         |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE |   | —      | 11     | 263      | 29,541  | 資本財・サービス   |
| HERSHEY CO/THE               |   | 33     | 33     | 364      | 40,859  | 生活必需品      |
| HARLEY-DAVIDSON INC          |   | 45     | 40     | 195      | 21,952  | 一般消費財・サービス |
| HUMANA INC                   |   | 35     | 33     | 825      | 92,489  | ヘルスケア      |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        |   | 68     | 82     | 926      | 103,825 | 情報技術       |
| HELMERICH & PAYNE            |   | 26     | 26     | 148      | 16,617  | エネルギー      |
| HENRY SCHEIN INC             |   | 19     | 36     | 253      | 28,357  | ヘルスケア      |
| HP INC                       |   | 407    | 389    | 833      | 93,407  | 情報技術       |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   |   | 377    | 377    | 526      | 59,013  | 情報技術       |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C |   | 45     | 40     | 163      | 18,331  | 一般消費財・サービス |
| HOLLYFRONTIER CORP           |   | 39     | 39     | 172      | 19,371  | エネルギー      |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A |   | 21     | 21     | 85       | 9,602   | 一般消費財・サービス |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       |   | 28     | 29     | 279      | 31,269  | 金融         |
| HARMAN INTERNATIONAL         |   | 16     | —      | —        | —       | その他        |
| KRAFT HEINZ CO/THE           |   | 139.53 | 138.53 | 1,123    | 125,870 | 生活必需品      |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  |   | 209.5  | 204.5  | 3,140    | 351,847 | 情報技術       |
| INTERNATIONAL PAPER CO       |   | 91     | 91     | 505      | 56,611  | 素材         |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI |   | 36     | 36     | 240      | 26,974  | 資本財・サービス   |
| ZOETIS INC                   |   | 107    | 114    | 816      | 91,472  | ヘルスケア      |
| INGERSOLL-RAND PLC           |   | 60.29  | 57.79  | 497      | 55,733  | 資本財・サービス   |



外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 株数     | 当株数    | 期末評価額    |           | 業種等        |
|------------------------------|--------|--------|----------|-----------|------------|
|                              |        |        | 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        |            |
| CHENIERE ENERGY INC          | 47     | 47     | 225      | 25,278    | エネルギー      |
| ALLEGION PLC                 | —      | 22     | 182      | 20,445    | 資本財・サービス   |
| LEGGETT & PLATT INC          | 31     | 31     | 149      | 16,707    | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C        | 145.23 | 130.23 | 407      | 45,630    | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C | 24.37  | —      | —        | —         | 一般消費財・サービス |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 41.05  | 61.57  | 425      | 47,671    | 資本財・サービス   |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 82     | 89     | 263      | 29,528    | 情報技術       |
| JM SMUCKER CO/THE            | 27.2   | 27.2   | 320      | 35,859    | 生活必需品      |
| JOHNSON & JOHNSON            | 624    | 614    | 8,584    | 961,874   | ヘルスケア      |
| ABBVIE INC                   | 373.79 | 364.29 | 3,490    | 391,124   | ヘルスケア      |
| HOLOGIC INC                  | 57.5   | 65.5   | 276      | 31,023    | ヘルスケア      |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 83.5   | 81.5   | 970      | 108,799   | 生活必需品      |
| KROGER CO                    | 212    | 206    | 502      | 56,274    | 生活必需品      |
| KLA-TENCOR CORP              | 37     | 36.5   | 366      | 41,041    | 情報技術       |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 61.5   | 60     | 1,924    | 215,646   | 資本財・サービス   |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC    | 21     | 21     | 376      | 42,241    | 情報技術       |
| L BRANDS INC                 | 56     | 56     | 294      | 32,961    | 一般消費財・サービス |
| LOWE'S COS INC               | 205    | 197    | 1,641    | 183,875   | 一般消費財・サービス |
| ELI LILLY & CO               | 227.5  | 225.5  | 1,915    | 214,670   | ヘルスケア      |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC   | 69     | —      | —        | —         | その他        |
| LAM RESEARCH CORP            | 37     | 37     | 720      | 80,694    | 情報技術       |
| RANGE RESOURCES CORP         | 43     | 57     | 102      | 11,496    | エネルギー      |
| JONES LANG LASALLE INC       | 10     | 10     | 151      | 16,993    | 不動産        |
| LOEWS CORP                   | 65     | 65     | 327      | 36,656    | 金融         |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 54.49  | 51.49  | 394      | 44,165    | 金融         |
| MCDONALD'S CORP              | 194    | 185.5  | 3,161    | 354,243   | 一般消費財・サービス |
| 3M CO                        | 139    | 137    | 3,260    | 365,365   | 資本財・サービス   |
| FACEBOOK INC-A               | 531.5  | 541.5  | 9,483    | 1,062,602 | 情報技術       |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V   | 52.54  | 48.04  | 374      | 41,981    | 情報技術       |
| MANPOWERGROUP INC            | 17     | 15     | 194      | 21,817    | 資本財・サービス   |
| S&P GLOBAL INC               | 61.5   | 59.5   | 980      | 109,825   | 金融         |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 14     | 14     | 291      | 32,708    | 素材         |
| CONCHO RESOURCES INC         | 32.5   | 34.5   | 474      | 53,157    | エネルギー      |
| ENVISION HEALTHCARE CORP     | —      | 26.36  | 83       | 9,401     | ヘルスケア      |
| FIRST DATA CORP- CLASS A     | —      | 103    | 166      | 18,662    | 情報技術       |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC      | —      | 43     | 152      | 17,032    | 電気通信サービス   |
| PHILLIPS 66                  | 110    | 99.5   | 944      | 105,814   | エネルギー      |
| MURPHY OIL CORP              | 36     | 36     | 101      | 11,343    | エネルギー      |
| TECHNIPFMC PLC               | —      | 100    | 275      | 30,892    | エネルギー      |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 108    | 107.5  | 361      | 40,532    | 一般消費財・サービス |
| MATTEL INC                   | 78     | 78     | 142      | 15,941    | 一般消費財・サービス |
| DXC TECHNOLOGY CO            | —      | 65.38  | 624      | 69,976    | 情報技術       |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 26.5   | 26.5   | 270      | 30,322    | 生活必需品      |
| MYLAN NV                     | 104.5  | 104.5  | 385      | 43,160    | ヘルスケア      |
| METLIFE INC                  | 213.5  | 208.5  | 1,116    | 125,105   | 金融         |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 105    | 91     | 202      | 22,646    | 情報技術       |
| ARISTA NETWORKS INC          | —      | 11     | 257      | 28,867    | 情報技術       |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A   | —      | 25     | 124      | 13,944    | 金融         |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 36.78  | 38.28  | 360      | 40,392    | 情報技術       |
| MONSANTO CO                  | 100.56 | 100.56 | 1,183    | 132,632   | 素材         |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 6      | 6      | 375      | 42,048    | ヘルスケア      |
| BAKER HUGHES A GE CO         | —      | 91.73  | 275      | 30,814    | エネルギー      |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 29.5   | 29.5   | 560      | 62,846    | 資本財・サービス   |

| 銘柄                           | 期首         | 当          | 期末       |          | 業種等        |
|------------------------------|------------|------------|----------|----------|------------|
|                              | 株数         | 株数         | 評価額      |          |            |
|                              |            |            | 外貨建金額    | 邦貨換算金額   |            |
|                              | 百株         | 百株         | 千アメリカ・ドル | 千円       |            |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC    | —          | 19. 4      | 115      | 12, 920  | 金融         |
| MERCK & CO. INC.             | 638. 71    | 627. 71    | 3, 475   | 389, 374 | ヘルスケア      |
| DOWDUPONT INC                | —          | 535. 05    | 3, 840   | 430, 337 | 素材         |
| MASCO CORP                   | 74         | 74         | 311      | 34, 850  | 資本財・サービス   |
| M & T BANK CORP              | 33. 69     | 31. 69     | 535      | 60, 048  | 金融         |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 121. 5     | 117. 5     | 982      | 110, 066 | 金融         |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 75. 22     | 74. 72     | 945      | 105, 902 | 一般消費財・サービス |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 26. 5      | 29. 5      | 314      | 35, 216  | 情報技術       |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD    | 39. 5      | 35. 5      | 208      | 23, 329  | 一般消費財・サービス |
| VANTIV INC - CL A            | 35. 5      | 38. 5      | 278      | 31, 168  | 情報技術       |
| NETAPP INC                   | 67         | 61. 5      | 345      | 38, 748  | 情報技術       |
| NIKE INC -CL B               | 305. 5     | 300. 5     | 1, 813   | 203, 238 | 一般消費財・サービス |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 67. 5      | 67         | 913      | 102, 407 | 資本財・サービス   |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 48. 5      | 53. 5      | 463      | 51, 901  | 情報技術       |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 30         | 30         | 265      | 29, 715  | 金融         |
| ALLY FINANCIAL INC           | 102        | 102        | 271      | 30, 469  | 金融         |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 39. 5      | 38. 3      | 1, 174   | 131, 616 | 資本財・サービス   |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC        | 62         | 62         | 632      | 70, 895  | 一般消費財・サービス |
| NEWMONT MINING CORP          | 120        | 120        | 439      | 49, 212  | 素材         |
| MCKESSON CORP                | 51. 5      | 49         | 725      | 81, 324  | ヘルスケア      |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 64         | 64         | 333      | 37, 369  | 情報技術       |
| XYLEM INC                    | 42         | 42         | 286      | 32, 095  | 資本財・サービス   |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 358. 5     | 356        | 3, 655   | 409, 588 | 生活必需品      |
| NUCOR CORP                   | 71. 5      | 74         | 424      | 47, 561  | 素材         |
| WESTERN UNION CO             | 113. 46    | 113. 46    | 223      | 25, 044  | 情報技術       |
| NEWELL BRANDS INC            | 101. 42    | 108. 92    | 332      | 37, 235  | 一般消費財・サービス |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 175. 5     | 174        | 1, 216   | 136, 281 | エネルギー      |
| LIBERTY BROADBAND-C          | 26         | 25. 5      | 223      | 25, 092  | 一般消費財・サービス |
| SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC | —          | 6          | 69       | 7, 736   | 生活必需品      |
| PAYCHEX INC                  | 75. 5      | 75. 5      | 502      | 56, 325  | 情報技術       |
| PATTERSON COS INC            | 19         | 19         | 70       | 7, 866   | ヘルスケア      |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 22         | 21. 2      | 500      | 56, 136  | 一般消費財・サービス |
| ALTRIA GROUP INC             | 450. 5     | 442. 5     | 2, 981   | 334, 034 | 生活必需品      |
| P G & E CORP                 | 115        | 116        | 638      | 71, 565  | 公益事業       |
| PFIZER INC                   | 1, 396. 63 | 1, 363. 63 | 4, 937   | 553, 269 | ヘルスケア      |
| ALKERMES PLC                 | 36         | 36         | 185      | 20, 753  | ヘルスケア      |
| XCEL ENERGY INC              | 115        | 115        | 589      | 66, 052  | 公益事業       |
| STRYKER CORP                 | 78. 5      | 76. 5      | 1, 178   | 132, 091 | ヘルスケア      |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 30. 5      | 30. 5      | 562      | 62, 991  | 資本財・サービス   |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 37. 5      | 39         | 589      | 66, 056  | エネルギー      |
| POLARIS INDUSTRIES INC       | 14         | 14         | 180      | 20, 245  | 一般消費財・サービス |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 581. 67    | 586. 17    | 5, 239   | 587, 050 | 生活必需品      |
| EXELON CORP                  | 213. 22    | 212. 22    | 884      | 99, 135  | 公益事業       |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 51         | 51         | 547      | 61, 357  | ヘルスケア      |
| NVR INC                      | —          | 0. 8       | 277      | 31, 090  | 一般消費財・サービス |
| CONOCOPHILLIPS               | 286. 5     | 282. 5     | 1, 433   | 160, 581 | エネルギー      |
| PEPSICO INC                  | 327        | 326        | 3, 808   | 426, 796 | 生活必需品      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 102        | 99         | 1, 147   | 128, 534 | 金融         |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 40. 5      | 40. 5      | 365      | 41, 001  | 公益事業       |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 145. 5     | 142        | 2, 086   | 233, 813 | 情報技術       |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD    | 22         | 19. 5      | 104      | 11, 702  | 金融         |
| PENTAIR PLC                  | 40. 05     | 40. 05     | 277      | 31, 108  | 資本財・サービス   |
| QUALCOMM INC                 | 336. 5     | 336        | 2, 235   | 250, 439 | 情報技術       |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                             | 株数       | 株数       | 期末評価額    |         | 業種等        |
|--------------------------------|----------|----------|----------|---------|------------|
|                                |          |          | 外貨建金額    |         |            |
|                                |          |          | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| INVESCO LTD                    | 98.5     | 91.5     | 330      | 37,011  | 金融         |
| ADVANCE AUTO PARTS INC         | 17       | 17       | 169      | 19,038  | 一般消費財・サービス |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP      | 66       | 66       | 472      | 52,905  | 金融         |
| RAYTHEON COMPANY               | 69       | 67       | 1,263    | 141,573 | 資本財・サービス   |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A    | 18       | 20.5     | 166      | 18,690  | 一般消費財・サービス |
| RED HAT INC                    | 42       | 40       | 497      | 55,796  | 情報技術       |
| REGENERON PHARMACEUTICALS      | 18.1     | 18.1     | 649      | 72,733  | ヘルスケア      |
| REPUBLIC SERVICES INC          | 56.5     | 53.5     | 344      | 38,551  | 資本財・サービス   |
| PRICELINE GROUP INC/THE        | 11.4     | 11.2     | 1,942    | 217,666 | 一般消費財・サービス |
| ROSS STORES INC                | 94       | 90       | 683      | 76,591  | 一般消費財・サービス |
| PACKAGING CORP OF AMERICA      | 21       | 21       | 241      | 27,081  | 素材         |
| RESMED INC                     | 32.5     | 32.5     | 277      | 31,044  | ヘルスケア      |
| QUEST DIAGNOSTICS INC          | 33       | 31       | 301      | 33,808  | ヘルスケア      |
| ROBERT HALF INTL INC           | 28       | 28       | 159      | 17,826  | 資本財・サービス   |
| REYNOLDS AMERICAN INC          | 196.78   | —        | —        | —       | その他        |
| RITE AID CORP                  | 230      | —        | —        | —       | 生活必需品      |
| RALPH LAUREN CORP              | 13       | 13       | 123      | 13,787  | 一般消費財・サービス |
| AUTONATION INC                 | 17       | 17       | 94       | 10,545  | 一般消費財・サービス |
| ROCKWELL COLLINS INC           | 29       | 36.63    | 483      | 54,169  | 資本財・サービス   |
| REGIONS FINANCIAL CORP         | 288.35   | 274.35   | 454      | 50,937  | 金融         |
| CHEVRON CORP                   | 433.18   | 432.18   | 5,064    | 567,453 | エネルギー      |
| EDISON INTERNATIONAL           | 75       | 75       | 610      | 68,414  | 公益事業       |
| TESLA INC                      | 26.7     | 30.4     | 934      | 104,757 | 一般消費財・サービス |
| SYMANTEC CORP                  | 147      | 139      | 397      | 44,497  | 情報技術       |
| ENDO INTERNATIONAL PLC         | 46       | —        | —        | —       | ヘルスケア      |
| STANLEY BLACK & DECKER INC     | 34.72    | 34.72    | 581      | 65,206  | 資本財・サービス   |
| SYNOPSIS INC                   | 34       | 34       | 295      | 33,056  | 情報技術       |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A   | 48.85    | 49.05    | 1,626    | 182,287 | 一般消費財・サービス |
| CBRE GROUP INC - A             | 71       | 71       | 305      | 34,200  | 不動産        |
| TWITTER INC                    | 130      | 144      | 299      | 33,545  | 情報技術       |
| NAVIENT CORP                   | 87       | 71       | 91       | 10,206  | 金融         |
| SOUTHERN CO/THE                | 217.5    | 225.5    | 1,152    | 129,090 | 公益事業       |
| SYSCO CORP                     | 124      | 118      | 680      | 76,290  | 生活必需品      |
| TRAVELERS COS INC/THE          | 67.23    | 64.73    | 870      | 97,574  | 金融         |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO         | 110      | —        | —        | —       | エネルギー      |
| SEI INVESTMENTS COMPANY        | 32       | 32       | 223      | 25,020  | 金融         |
| STERICYCLE INC                 | 19.5     | 19.5     | 127      | 14,265  | 資本財・サービス   |
| STEEL DYNAMICS INC             | —        | 57       | 215      | 24,187  | 素材         |
| SCHLUMBERGER LTD               | 322.02   | 316.52   | 1,967    | 220,421 | エネルギー      |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING   | 39       | 39       | 195      | 21,919  | 資本財・サービス   |
| AT&T INC                       | 1,414.91 | 1,402.91 | 5,117    | 573,451 | 電気通信サービス   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO          | 38       | 34       | 200      | 22,431  | 資本財・サービス   |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE        | 18.3     | 19.3     | 760      | 85,196  | 素材         |
| SEMPRA ENERGY                  | 54       | 54       | 649      | 72,765  | 公益事業       |
| TIFFANY & CO                   | 28       | 28       | 259      | 29,036  | 一般消費財・サービス |
| SEAGATE TECHNOLOGY             | 70       | 71       | 275      | 30,827  | 情報技術       |
| TEXAS INSTRUMENTS INC          | 230      | 227.5    | 2,204    | 246,960 | 情報技術       |
| SALESFORCE.COM INC             | 147      | 154.5    | 1,599    | 179,228 | 情報技術       |
| SIGNET JEWELERS LTD            | 17       | 13       | 68       | 7,629   | 一般消費財・サービス |
| WESTROCK CO                    | 59.3     | 59.3     | 357      | 40,040  | 素材         |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL | 217.84   | 215.84   | 822      | 92,120  | 資本財・サービス   |
| ANDEAVOR                       | 28.5     | 34.5     | 362      | 40,648  | エネルギー      |
| UNION PACIFIC CORP             | 189      | 186      | 2,286    | 256,222 | 資本財・サービス   |

| 銘                            | 柄 | 期 首      | 当        | 期 末      |         | 業 種 等      |
|------------------------------|---|----------|----------|----------|---------|------------|
|                              |   | 株 数      | 株 数      | 評 価 額    |         |            |
|                              |   |          |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |            |
|                              |   | 百株       | 百株       | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| MARATHON OIL CORP            |   | 190      | 190      | 280      | 31,402  | エネルギー      |
| MARATHON PETROLEUM CORP      |   | 123      | 119      | 730      | 81,870  | エネルギー      |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP     |   | 182.5    | 174.5    | 2,061    | 231,034 | 資本財・サービス   |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   |   | 159.5    | 157      | 1,868    | 209,413 | 資本財・サービス   |
| UNUM GROUP                   |   | 54       | 54       | 304      | 34,138  | 金融         |
| SPRINT CORP                  |   | 177.65   | 177.65   | 107      | 12,082  | 電気通信サービス   |
| ANTERO RESOURCES CORP        |   | 34       | 51       | 95       | 10,720  | エネルギー      |
| IQVIA HOLDINGS INC           |   | 34.94    | 31.94    | 323      | 36,257  | ヘルスケア      |
| VOYA FINANCIAL INC           |   | 50       | 45       | 197      | 22,150  | 金融         |
| AMEREN CORPORATION           |   | 55       | 55       | 350      | 39,244  | 公益事業       |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       |   | 220.26   | 220.76   | 4,920    | 551,319 | ヘルスケア      |
| VERISIGN INC                 |   | 22       | 22       | 252      | 28,284  | 情報技術       |
| VALERO ENERGY CORP           |   | 107.92   | 103.42   | 861      | 96,576  | エネルギー      |
| ULTA BEAUTY INC              |   | 13.9     | 13.1     | 292      | 32,747  | 一般消費財・サービス |
| FNF GROUP                    |   | 57.38    | 57.38    | 230      | 25,852  | 金融         |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  |   | 20       | 20       | 214      | 24,084  | ヘルスケア      |
| ANTHEM INC                   |   | 60.5     | 60.5     | 1,375    | 154,094 | ヘルスケア      |
| WALT DISNEY CO/THE           |   | 347      | 358.5    | 3,772    | 422,748 | 一般消費財・サービス |
| WELLS FARGO & CO             |   | 1,107.72 | 1,084.72 | 6,148    | 688,905 | 金融         |
| FOOT LOCKER INC              |   | 32       | 32       | 136      | 15,271  | 一般消費財・サービス |
| WASTE MANAGEMENT INC         |   | 103      | 100      | 826      | 92,575  | 資本財・サービス   |
| WILLIAMS COS INC             |   | 167      | 187      | 529      | 59,339  | エネルギー      |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       |   | 31       | 31       | 215      | 24,092  | 一般消費財・サービス |
| WHIRLPOOL CORP               |   | 17       | 17       | 287      | 32,190  | 一般消費財・サービス |
| WAL-MART STORES INC          |   | 351.5    | 346.5    | 3,380    | 378,779 | 生活必需品      |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   |   | 46       | 46       | 535      | 60,057  | ヘルスケア      |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PL |   | 195      | 221      | 71       | 7,973   | エネルギー      |
| WYNN RESORTS LTD             |   | 18       | 19.5     | 304      | 34,100  | 一般消費財・サービス |
| XEROX CORP                   |   | 192.44   | 48.11    | 140      | 15,794  | 情報技術       |
| WABTEC CORP                  |   | 21       | 19       | 146      | 16,392  | 資本財・サービス   |
| TJX COMPANIES INC            |   | 153.5    | 148.5    | 1,110    | 124,429 | 一般消費財・サービス |
| WATERS CORP                  |   | 18       | 18       | 352      | 39,466  | ヘルスケア      |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS  |   | 20       | 18       | 111      | 12,522  | 資本財・サービス   |
| ALLERGAN PLC                 |   | 90.57    | 76.57    | 1,345    | 150,736 | ヘルスケア      |
| WHOLE FOODS MARKET INC       |   | 78       | —        | —        | —       | その他        |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC |   | 212.5    | 211      | 1,517    | 170,037 | 生活必需品      |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     |   | 30.83    | 29.83    | 474      | 53,168  | 金融         |
| WESTERN DIGITAL CORP         |   | 64.5     | 67.5     | 546      | 61,263  | 情報技術       |
| WEC ENERGY GROUP INC         |   | 73.8     | 71.3     | 493      | 55,332  | 公益事業       |
| WESTAR ENERGY INC            |   | 32       | 32       | 180      | 20,183  | 公益事業       |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP |   | 117.5    | 117.5    | 619      | 69,384  | 公益事業       |
| VISA INC-CLASS A SHARES      |   | 429.5    | 423      | 4,647    | 520,705 | 情報技術       |
| PPL CORP                     |   | 154      | 154      | 563      | 63,173  | 公益事業       |
| PULTEGROUP INC               |   | 74       | 67       | 226      | 25,382  | 一般消費財・サービス |
| PPG INDUSTRIES INC           |   | 61.5     | 59.5     | 696      | 78,010  | 素材         |
| NORTHERN TRUST CORP          |   | 49       | 49       | 481      | 53,938  | 金融         |
| NVIDIA CORP                  |   | 124      | 136.5    | 2,681    | 300,420 | 情報技術       |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP |   | 113.93   | 110.93   | 1,550    | 173,680 | 金融         |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A |   | 95.5     | 95.5     | 233      | 26,184  | 一般消費財・サービス |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC       |   | —        | 47       | 171      | 19,243  | 資本財・サービス   |
| TYSON FOODS INC-CL A         |   | 69       | 65       | 533      | 59,737  | 生活必需品      |
| NETFLIX INC                  |   | 98       | 99       | 1,862    | 208,713 | 一般消費財・サービス |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC |   | 90.5     | 89.5     | 1,723    | 193,168 | ヘルスケア      |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 株数       | 株数       | 期末評価額    |         | 業種等        |
|------------------------------|----------|----------|----------|---------|------------|
|                              |          |          | 外貨建金額    |         |            |
|                              |          |          | 千アメリカ・ドル | 千円      |            |
| TORCHMARK CORP               | 26.75    | 26.75    | 238      | 26,703  | 金融         |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 34       | 37       | 356      | 39,999  | 金融         |
| TEXTRON INC                  | 63.5     | 63.5     | 348      | 39,019  | 資本財・サービス   |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A   | 249.5    | 239.5    | 768      | 86,143  | 一般消費財・サービス |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B | 103      | 103      | 322      | 36,123  | 一般消費財・サービス |
| NEWS CORP - CLASS A          | 83.37    | 83.37    | 136      | 15,273  | 一般消費財・サービス |
| OGE ENERGY CORP              | 47       | 47       | 165      | 18,579  | 公益事業       |
| OMNICOM GROUP                | 55       | 54       | 393      | 44,127  | 一般消費財・サービス |
| ORACLE CORP                  | 702.83   | 707.33   | 3,431    | 384,551 | 情報技術       |
| MASTERCARD INC - A           | 224.5    | 217.5    | 3,226    | 361,541 | 情報技術       |
| ONEOK INC                    | 49       | 88       | 443      | 49,725  | エネルギー      |
| CENTURYLINK INC              | 127.95   | 226.52   | 329      | 36,904  | 電気通信サービス   |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 23       | 23       | 603      | 67,583  | 資本財・サービス   |
| YUM! BRANDS INC              | 83       | 75       | 613      | 68,751  | 一般消費財・サービス |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 14       | 11.5     | 268      | 30,050  | 情報技術       |
| MOLSON COORS BREWING CO -B   | 44       | 43.5     | 332      | 37,297  | 生活必需品      |
| NOBLE ENERGY INC             | 101      | 109      | 282      | 31,645  | エネルギー      |
| BANK OF AMERICA CORP         | 2,325.01 | 2,280.01 | 6,447    | 722,483 | 金融         |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 38       | 41       | 341      | 38,254  | ヘルスケア      |
| NORDSTROM INC                | 30       | 30       | 137      | 15,382  | 一般消費財・サービス |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 178      | 173.5    | 1,676    | 187,796 | 金融         |
| ANALOG DEVICES INC           | 70       | 82.99    | 710      | 79,655  | 情報技術       |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | —        | 180      | 194      | 21,843  | 情報技術       |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 60       | 60       | 305      | 34,199  | 金融         |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 243.22   | 210.22   | 1,267    | 142,037 | 金融         |
| ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC  | 14       | —        | —        | —       | 素材         |
| ANADARKO PETROLEUM CORP      | 127      | 127      | 608      | 68,134  | エネルギー      |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 44       | 41.5     | 437      | 48,979  | 情報技術       |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 40.5     | 40       | 498      | 55,890  | 一般消費財・サービス |
| NEWFIELD EXPLORATION CO      | 45       | 45       | 135      | 15,177  | エネルギー      |
| MALLINCKRODT PLC             | 25       | 25       | 55       | 6,199   | ヘルスケア      |
| AVERY DENNISON CORP          | 21       | 21       | 234      | 26,325  | 素材         |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 141.5    | 136      | 980      | 109,886 | 情報技術       |
| EMERSON ELECTRIC CO          | 148.5    | 149      | 951      | 106,633 | 資本財・サービス   |
| AON PLC                      | 62       | 60       | 842      | 94,437  | 金融         |
| AMGEN INC                    | 174      | 168.5    | 2,902    | 325,177 | ヘルスケア      |
| CORE LABORATORIES N. V.      | 10       | 10       | 99       | 11,159  | エネルギー      |
| TAPESTRY INC                 | 64       | 64       | 265      | 29,767  | 一般消費財・サービス |
| EATON CORP PLC               | 104.36   | 101.36   | 778      | 87,270  | 資本財・サービス   |
| CELGENE CORP                 | 179      | 178      | 1,835    | 205,671 | ヘルスケア      |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 41.2     | 38.8     | 831      | 93,193  | 生活必需品      |
| APPLIED MATERIALS INC        | 245      | 245      | 1,296    | 145,249 | 情報技術       |
| CIT GROUP INC                | 45       | 33       | 164      | 18,384  | 金融         |
| CIMAREX ENERGY CO            | 22.5     | 22.5     | 257      | 28,798  | エネルギー      |
| CME GROUP INC                | 78       | 78       | 1,153    | 129,201 | 金融         |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 88.44    | 88.44    | 288      | 32,315  | エネルギー      |
| ECOLAB INC                   | 61.5     | 59       | 796      | 89,247  | 素材         |
| EQUIFAX INC                  | 27.5     | 27.5     | 309      | 34,711  | 資本財・サービス   |
| GAP INC/THE                  | 58       | 58       | 188      | 21,121  | 一般消費財・サービス |
| GILEAD SCIENCES INC          | 306      | 300      | 2,210    | 247,641 | ヘルスケア      |
| ST JUDE MEDICAL INC          | 64.5     | —        | —        | —       | その他        |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC  | 43.98    | 41.48    | 371      | 41,579  | 生活必需品      |
| HORMEL FOODS CORP            | 68.5     | 68.5     | 246      | 27,623  | 生活必需品      |

| 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        |            |
| STATE STREET CORP            | 91.93   | 87.43   | 827      | 92,753    | 金融         |
| STAPLES INC                  | 156     | —       | —        | —         | その他        |
| SUNTRUST BANKS INC           | 115.98  | 111.98  | 686      | 76,915    | 金融         |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 274     | 277     | 1,341    | 150,285   | 金融         |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 114     | 113.5   | 739      | 82,893    | ヘルスケア      |
| B/E AEROSPACE INC            | 23      | —       | —        | —         | その他        |
| CAMPBELL SOUP CO             | 46      | 41      | 200      | 22,506    | 生活必需品      |
| CROWN HOLDINGS INC           | 31      | 31      | 183      | 20,570    | 素材         |
| CARDINAL HEALTH INC          | 75.5    | 71.5    | 422      | 47,356    | ヘルスケア      |
| FEDEX CORP                   | 58.5    | 58.5    | 1,321    | 148,095   | 資本財・サービス   |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 114.04  | 109.54  | 996      | 111,656   | 金融         |
| FMC CORP                     | 32      | 31.5    | 293      | 32,899    | 素材         |
| FLEX LTD                     | 122     | 122     | 220      | 24,756    | 情報技術       |
| CERNER CORP                  | 70      | 67      | 467      | 52,378    | ヘルスケア      |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 18      | 18      | 278      | 31,173    | 素材         |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 36.5    | 35      | 304      | 34,119    | 情報技術       |
| INTEL CORP                   | 1,084   | 1,079   | 4,742    | 531,364   | 情報技術       |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 88      | 88      | 176      | 19,770    | 一般消費財・サービス |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 91      | 82.5    | 475      | 53,292    | 金融         |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 74      | 70.5    | 1,169    | 131,037   | 資本財・サービス   |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 450     | 385     | 210      | 23,640    | 一般消費財・サービス |
| ILLUMINA INC                 | 33.5    | 33.5    | 762      | 85,388    | ヘルスケア      |
| SEALED AIR CORP              | 44      | 44      | 208      | 23,339    | 素材         |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 8.7     | 25.2    | 993      | 111,336   | ヘルスケア      |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 31      | 29      | 295      | 33,163    | 情報技術       |
| SNAP-ON INC                  | 13      | 13      | 217      | 24,358    | 資本財・サービス   |
| CALPINE CORP                 | 72      | —       | —        | —         | 公益事業       |
| CARMAX INC                   | 46      | 42.5    | 291      | 32,620    | 一般消費財・サービス |
| COMERICA INC                 | 40      | 40      | 333      | 37,420    | 金融         |
| INGREDION INC                | 16      | 16      | 223      | 25,054    | 生活必需品      |
| DUKE ENERGY CORP             | 158.28  | 160.78  | 1,430    | 160,337   | 公益事業       |
| TARGET CORP                  | 129     | 119.5   | 737      | 82,589    | 一般消費財・サービス |
| DOVER CORP                   | 35      | 35      | 335      | 37,593    | 資本財・サービス   |
| WW GRAINGER INC              | 13      | 13      | 281      | 31,575    | 資本財・サービス   |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 29      | 29      | 188      | 21,066    | 資本財・サービス   |
| CINTAS CORP                  | 21      | 21      | 322      | 36,173    | 資本財・サービス   |
| CA INC                       | 71.05   | 71.05   | 231      | 25,937    | 情報技術       |
| CONAGRA BRANDS INC           | 95      | 95      | 353      | 39,598    | 生活必需品      |
| CLOROX COMPANY               | 29.5    | 29.5    | 410      | 46,018    | 生活必需品      |
| ENTERGY CORP                 | 42.5    | 42      | 361      | 40,543    | 公益事業       |
| MICROSOFT CORP               | 1,693.5 | 1,675.5 | 13,963   | 1,564,623 | 情報技術       |
| INCYTE CORP                  | 38.5    | 40.5    | 388      | 43,546    | ヘルスケア      |
| CVS HEALTH CORP              | 247.24  | 231.74  | 1,700    | 190,593   | 生活必需品      |
| MEDTRONIC PLC                | 316.38  | 314.38  | 2,581    | 289,242   | ヘルスケア      |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 241     | 241     | 1,054    | 118,115   | 情報技術       |
| BLACKROCK INC                | 28.5    | 27.5    | 1,377    | 154,321   | 金融         |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 91      | 91      | 269      | 30,253    | 公益事業       |
| HASBRO INC                   | 26      | 26      | 241      | 27,047    | 一般消費財・サービス |
| KELLOGG CO                   | 61      | 61      | 407      | 45,658    | 生活必需品      |
| KEYCORP                      | 245     | 247     | 469      | 52,612    | 金融         |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 24      | 24      | 264      | 29,613    | 資本財・サービス   |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 356.11  | 350.11  | 1,503    | 168,452   | 生活必需品      |
| KOHL'S CORP                  | 44      | 39      | 186      | 20,844    | 一般消費財・サービス |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                          |                     | 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                    |            |
| COOPER COS INC/THE          |                     | 11                 | 11                 | 266      | 29,900                | ヘルスケア      |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP  |                     | 111                | 111                | 149      | 16,765                | 金融         |
| APACHE CORP                 |                     | 87.6               | 87.6               | 356      | 39,988                | エネルギー      |
| CHUBB LTD                   |                     | 107.99             | 106.49             | 1,625    | 182,133               | 金融         |
| ARROW ELECTRONICS INC       |                     | 20                 | 20                 | 160      | 17,999                | 情報技術       |
| ALLSTATE CORP               |                     | 87                 | 83.5               | 851      | 95,395                | 金融         |
| EBAY INC                    |                     | 250                | 234                | 804      | 90,143                | 情報技術       |
| PAYPAL HOLDINGS INC         |                     | 249.5              | 261.5              | 1,915    | 214,630               | 情報技術       |
| EASTMAN CHEMICAL CO         |                     | 35                 | 32.5               | 297      | 33,288                | 素材         |
| XILINX INC                  |                     | 59.5               | 56                 | 388      | 43,534                | 情報技術       |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO  |                     | 143.1              | 135.1              | 849      | 95,157                | ヘルスケア      |
| DISH NETWORK CORP-A         |                     | 53                 | 53                 | 271      | 30,453                | 一般消費財・サービス |
| YAHOO! INC                  |                     | 210                | —                  | —        | —                     | その他        |
| ZIONS BANCORPORATION        |                     | —                  | 48                 | 237      | 26,617                | 金融         |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A |                     | 51.5               | 51.5               | 638      | 71,514                | 生活必需品      |
| TOLL BROTHERS INC           |                     | 38                 | 38                 | 190      | 21,327                | 一般消費財・サービス |
| TRIMBLE INC                 |                     | 59                 | 59                 | 244      | 27,395                | 情報技術       |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP      |                     | 56                 | —                  | —        | —                     | その他        |
| LENNAR CORP-A               |                     | 44                 | 48                 | 298      | 33,442                | 一般消費財・サービス |
| LEAR CORP                   |                     | 17                 | 15.5               | 277      | 31,105                | 一般消費財・サービス |
| E*TRADE FINANCIAL CORP      |                     | 65                 | 65                 | 310      | 34,799                | 金融         |
| PROGRESSIVE CORP            |                     | 134                | 134                | 702      | 78,752                | 金融         |
| PRAXAIR INC                 |                     | 66                 | 65                 | 1,008    | 113,014               | 素材         |
| PACCAR INC                  |                     | 79.87              | 79.87              | 551      | 61,760                | 資本財・サービス   |
| PVH CORP                    |                     | 19                 | 17.5               | 239      | 26,891                | 一般消費財・サービス |
| BIOGEN INC                  |                     | 50.8               | 48.8               | 1,561    | 174,955               | ヘルスケア      |
| IDEXX LABORATORIES INC      |                     | 20                 | 20                 | 308      | 34,511                | ヘルスケア      |
| STARBUCKS CORP              |                     | 336                | 331                | 1,903    | 213,296               | 一般消費財・サービス |
| PERRIGO CO PLC              |                     | 34                 | 30.5               | 267      | 29,978                | ヘルスケア      |
| EVERSOURCE ENERGY           |                     | 74.8               | 71.3               | 460      | 51,617                | 公益事業       |
| INTUIT INC                  |                     | 56                 | 56                 | 863      | 96,769                | 情報技術       |
| BORGWARNER INC              |                     | 48                 | 48                 | 263      | 29,505                | 一般消費財・サービス |
| BEST BUY CO INC             |                     | 71                 | 65                 | 382      | 42,847                | 一般消費財・サービス |
| BALL CORP                   |                     | 37.92              | 75.84              | 300      | 33,617                | 素材         |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP      |                     | 310.47             | 310.47             | 805      | 90,275                | ヘルスケア      |
| BED BATH & BEYOND INC       |                     | 36                 | 36                 | 83       | 9,301                 | 一般消費財・サービス |
| XL GROUP LTD                |                     | 68                 | 61                 | 241      | 27,025                | 金融         |
| ELECTRONIC ARTS INC         |                     | 70.5               | 71                 | 748      | 83,923                | 情報技術       |
| VULCAN MATERIALS CO         |                     | 30.5               | 30.5               | 380      | 42,671                | 素材         |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC  |                     | 56.5               | 56.5               | 812      | 91,005                | ヘルスケア      |
| VF CORP                     |                     | 77.5               | 77.5               | 574      | 64,373                | 一般消費財・サービス |
| CBS CORP-CLASS B NON VOTING |                     | 94.71              | 83.71              | 473      | 53,032                | 一般消費財・サービス |
| VIACOM INC-CLASS B          |                     | 81.71              | 81.71              | 232      | 26,020                | 一般消費財・サービス |
| MOHAWK INDUSTRIES INC       |                     | 15                 | 14.7               | 410      | 45,971                | 一般消費財・サービス |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC   |                     | 52                 | 63                 | 103      | 11,555                | 情報技術       |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC  |                     | 22                 | 22                 | 244      | 27,416                | ヘルスケア      |
| CARNIVAL CORP               |                     | 80.5               | 80.5               | 528      | 59,261                | 一般消費財・サービス |
| COMCAST CORP-CLASS A        |                     | 545.7              | 1,084.4            | 4,032    | 451,884               | 一般消費財・サービス |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD |                     | —                  | 52                 | 221      | 24,838                | 資本財・サービス   |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD  |                     | 58                 | 48                 | 310      | 34,846                | 資本財・サービス   |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD  |                     | 265                | 265                | 191      | 21,468                | 不動産        |
| アメリカ・ドル通貨計                  | 株数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 71,134.09<br>584銘柄 | 70,298.77<br>600銘柄 | 525,149  | 58,842,994<br><62.0%> |            |



| 銘柄                           | 株数    | 株数     | 期末評価額   |         | 業種等        |
|------------------------------|-------|--------|---------|---------|------------|
|                              |       |        | 外貨建金額   |         |            |
|                              |       |        | 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      |            |
| IMPERIAL OIL LTD             | 72    | 67     | 264     | 23,074  | エネルギー      |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 4.4   | 4.4    | 332     | 28,938  | 情報技術       |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD       | 46.96 | 46.96  | 152     | 13,240  | エネルギー      |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 53.87 | 51.87  | 429     | 37,435  | 一般消費財・サービス |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 107   | 107    | 284     | 24,753  | 素材         |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 31.5  | 31.5   | 341     | 29,763  | 金融         |
| BCE INC                      | 34.3  | 34.3   | 211     | 18,430  | 電気通信サービス   |
| FRANCO-NEVADA CORP           | 43    | 43     | 458     | 39,943  | 素材         |
| SUNCOR ENERGY INC            | 393.3 | 388.3  | 1,723   | 150,097 | エネルギー      |
| METRO INC                    | 55    | 55     | 221     | 19,315  | 生活必需品      |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 77    | 81     | 516     | 44,997  | 金融         |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 282   | 279    | 2,279   | 198,538 | 金融         |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 91.5  | 101.5  | 1,165   | 101,490 | 金融         |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 437   | 432    | 3,242   | 282,392 | 金融         |
| GREAT-WEST LIFECO INC        | 67    | 67     | 237     | 20,699  | 金融         |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 348.5 | 340.5  | 3,451   | 300,668 | 金融         |
| TOURMALINE OIL CORP          | 47    | 54     | 123     | 10,728  | エネルギー      |
| VERMILION ENERGY INC         | 25    | 28     | 124     | 10,862  | エネルギー      |
| TRANSCANADA CORP             | 189.5 | 205.5  | 1,272   | 110,866 | エネルギー      |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 94    | 116.29 | 507     | 44,202  | エネルギー      |
| BOMBARDIER INC-B             | 454   | 454    | 133     | 11,665  | 資本財・サービス   |
| BARRICK GOLD CORP            | 273   | 273    | 492     | 42,919  | 素材         |
| CAE INC                      | 58    | 58     | 130     | 11,391  | 資本財・サービス   |
| THOMSON REUTERS CORP         | 78.04 | 67.04  | 382     | 33,283  | 金融         |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN  | 202   | 194    | 486     | 42,378  | 素材         |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 39    | 39     | 96      | 8,424   | 生活必需品      |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 14    | 16     | 126     | 11,012  | 素材         |
| VERESEN INC                  | 80    | —      | —       | —       | その他        |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 6.9   | 34.5   | 206     | 17,999  | 素材         |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | 97    | 97     | 94      | 8,212   | 金融         |
| LINAMAR CORP                 | 11    | 11     | 74      | 6,522   | 一般消費財・サービス |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | 54    | 54     | 92      | 8,071   | エネルギー      |
| HYDRO ONE LTD                | 40    | 72     | 163     | 14,229  | 公益事業       |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 51.6  | 51.6   | 351     | 30,642  | 生活必需品      |
| EMERA INC                    | —     | 13     | 62      | 5,478   | 公益事業       |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 28    | 28     | 108     | 9,416   | 公益事業       |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 86    | 86     | 579     | 50,486  | 電気通信サービス   |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       | 51    | 55     | 308     | 26,850  | 素材         |
| KINROSS GOLD CORP            | 295   | 295    | 158     | 13,823  | 素材         |
| BANK OF MONTREAL             | 152   | 153    | 1,521   | 132,516 | 金融         |
| POWER CORP OF CANADA         | 87    | 81     | 265     | 23,161  | 金融         |
| METHANEX CORP                | 22    | 22     | 147     | 12,834  | 素材         |
| SHOPIFY INC - CLASS A        | —     | 19     | 253     | 22,076  | 情報技術       |
| CAMECO CORP                  | 92    | 92     | 108     | 9,415   | エネルギー      |
| TELUS CORP                   | 54    | 54     | 259     | 22,599  | 電気通信サービス   |
| POWER FINANCIAL CORP         | 56    | 57     | 202     | 17,634  | 金融         |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 134   | 134    | 390     | 33,998  | 素材         |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 17    | 16     | 260     | 22,703  | 一般消費財・サービス |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 208   | 248    | 94      | 8,208   | 素材         |
| AGRIUM INC                   | 31    | 33     | 460     | 40,133  | 素材         |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 255   | 261    | 1,116   | 97,274  | エネルギー      |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 5.4   | 6.4    | 446     | 38,893  | 金融         |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           |  | 期 首              |               | 期 末              |                               | 業 種 等      |
|------------------------------|--|------------------|---------------|------------------|-------------------------------|------------|
|                              |  | 株 数              | 株 数           | 評 価 額            |                               |            |
|                              |  |                  |               | 外貨建金額            | 邦貨換算金額                        |            |
|                              |  | 百株               | 百株            | 千カナダ・ドル          | 千円                            |            |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      |  | 93               | 84            | 595              | 51,902                        | 一般消費財・サービス |
| WESTON (GEORGE) LTD          |  | 11               | 11            | 120              | 10,479                        | 生活必需品      |
| BLACKBERRY LTD               |  | 119              | 119           | 163              | 14,199                        | 情報技術       |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       |  | 142.5            | 142.5         | 725              | 63,163                        | 金融         |
| ENBRIDGE INC                 |  | 220              | 381           | 1,743            | 151,821                       | エネルギー      |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A |  | 205.5            | 207.5         | 1,103            | 96,113                        | 金融         |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      |  | 469              | 460           | 1,246            | 108,538                       | 金融         |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTE |  | 71               | 71            | 150              | 13,128                        | ヘルスケア      |
| GOLDCORP INC                 |  | 199.59           | 199.59        | 324              | 28,266                        | 素材         |
| ENCANA CORP                  |  | 232              | 231           | 342              | 29,838                        | エネルギー      |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD |  | 34               | 34            | 757              | 65,977                        | 資本財・サービス   |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC |  | 22               | 25            | 147              | 12,877                        | 金融         |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        |  | 52               | 52            | 212              | 18,488                        | 一般消費財・サービス |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     |  | 183.5            | 175.5         | 1,723            | 150,109                       | 資本財・サービス   |
| CGI GROUP INC - CLASS A      |  | 53               | 50            | 340              | 29,618                        | 情報技術       |
| HUSKY ENERGY INC             |  | 75.58            | 84.58         | 129              | 11,249                        | エネルギー      |
| ONEX CORPORATION             |  | 20               | 20            | 183              | 16,005                        | 金融         |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    |  | 95               | 101           | 293              | 25,529                        | 一般消費財・サービス |
| FINNING INTERNATIONAL INC    |  | 39               | 39            | 118              | 10,309                        | 資本財・サービス   |
| SNC-LAVALIN GROUP INC        |  | 34               | 42            | 232              | 20,288                        | 資本財・サービス   |
| ELDORADO GOLD CORP           |  | 172              | —             | —                | —                             | 素材         |
| IGM FINANCIAL INC            |  | 23               | 19            | 84               | 7,385                         | 金融         |
| OPEN TEXT CORP               |  | 28               | 62            | 260              | 22,670                        | 情報技術       |
| CI FINANCIAL CORP            |  | 54               | 64            | 183              | 15,948                        | 金融         |
| SAPUTO INC                   |  | 58               | 48            | 210              | 18,307                        | 生活必需品      |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   |  | 171              | 158           | 229              | 19,968                        | 素材         |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B  |  | 98               | 98            | 642              | 55,977                        | 生活必需品      |
| YAMANA GOLD INC              |  | 233              | 233           | 79               | 6,900                         | 素材         |
| YAMANA GOLD INC-RTS          |  | 14.56            | —             | —                | —                             | その他        |
| FORTIS INC                   |  | 96               | 99            | 469              | 40,898                        | 公益事業       |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP   |  | 133              | 133           | 121              | 10,588                        | エネルギー      |
| CENOVUS ENERGY INC           |  | 196              | 240           | 283              | 24,708                        | エネルギー      |
| DOLLARAMA INC                |  | 27               | 25            | 402              | 35,079                        | 一般消費財・サービス |
| ATCO LTD -CLASS I            |  | 17               | 17            | 77               | 6,759                         | 公益事業       |
| ALTAGAS LTD                  |  | 39               | 39            | 113              | 9,861                         | エネルギー      |
| FIRST CAPITAL REALTY INC     |  | 26               | 38            | 79               | 6,897                         | 不動産        |
| KEYERA CORP                  |  | 40               | 44            | 157              | 13,708                        | エネルギー      |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP |  | 39               | 39            | 60               | 5,248                         | エネルギー      |
| INTER PIPELINE LTD           |  | 81               | 88            | 236              | 20,625                        | エネルギー      |
| ARC RESOURCES LTD            |  | 83               | 83            | 131              | 11,494                        | エネルギー      |
| カナダ・ドル通貨計                    |  | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 9,531<br>90銘柄 | 9,665.33<br>89銘柄 | 41,396<br>3,605,630<br><3.8%> |            |
| (オーストラリア)                    |  | 百株               | 百株            | 千オーストラリア・ドル      | 千円                            |            |
| HEALTHSCOPE LTD              |  | 375              | 375           | 73               | 6,253                         | ヘルスケア      |
| MEDIBANK PRIVATE LTD         |  | 617              | 617           | 199              | 16,913                        | 金融         |
| BHP BILLITON LIMITED         |  | 752              | 747           | 2,064            | 175,231                       | 素材         |
| SOUTH32 LTD                  |  | 1,272            | 1,207         | 404              | 34,316                        | 素材         |
| LENDLEASE GROUP              |  | 121              | —             | —                | —                             | 不動産        |
| ALUMINA LTD                  |  | 699              | 569           | 131              | 11,155                        | 素材         |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD       |  | 182              | 176           | 548              | 46,529                        | エネルギー      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD   |  | 397              | 355           | 164              | 13,919                        | 素材         |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK    |  | 118              | 118           | 134              | 11,456                        | 金融         |

| 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     | 千オーストラリア・ドル | 千円      |            |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD  | 620    | 626    | 1,851       | 157,154 | 金融         |
| WESTPAC BANKING CORP         | 780.98 | 788.48 | 2,482       | 210,658 | 金融         |
| SANTOS LTD                   | 340    | 428    | 220         | 18,707  | エネルギー      |
| AUSNET SERVICES              | 410    | 410    | 76          | 6,472   | 公益事業       |
| AUST AND NZ BANKING GROUP    | 689    | 684    | 1,967       | 167,012 | 金融         |
| RIO TINTO LTD                | 97     | 100    | 717         | 60,851  | 素材         |
| ORIGIN ENERGY LTD            | 414    | 414    | 374         | 31,763  | エネルギー      |
| AMCOR LIMITED                | 267    | 268    | 417         | 35,391  | 素材         |
| AURIZON HOLDINGS LTD         | 468    | 468    | 243         | 20,653  | 資本財・サービス   |
| VOCUS GROUP LTD              | 100    | —      | —           | —       | 電気通信サービス   |
| OIL SEARCH LTD               | 329    | 329    | 232         | 19,741  | エネルギー      |
| SEEK LTD                     | 75     | 75     | 140         | 11,903  | 資本財・サービス   |
| TREASURY WINE ESTATES LTD    | 171    | 171    | 265         | 22,494  | 生活必需品      |
| NEWCREST MINING LTD          | 176    | 176    | 423         | 35,938  | 素材         |
| INCITEC PIVOT LTD            | 456    | 382    | 152         | 12,903  | 素材         |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 401    | 405.5  | 3,283       | 278,690 | 金融         |
| CALTEX AUSTRALIA LTD         | 60     | 60     | 204         | 17,344  | エネルギー      |
| ORICA LTD                    | 83     | 83     | 142         | 12,116  | 素材         |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      | 328    | 323    | 344         | 29,249  | 金融         |
| CIMIC GROUP LTD              | 29     | 21     | 109         | 9,283   | 資本財・サービス   |
| WOOLWORTHS LTD               | 300    | 300    | 808         | 68,642  | 生活必需品      |
| COCA-COLA AMATIL LTD         | 137    | 137    | 106         | 9,022   | 生活必需品      |
| TABCORP HOLDINGS LTD         | 205    | 205    | 99          | 8,438   | 一般消費財・サービス |
| CROWN RESORTS LTD            | 106    | 96     | 120         | 10,200  | 一般消費財・サービス |
| QANTAS AIRWAYS LTD           | 145.54 | 102.54 | 57          | 4,916   | 資本財・サービス   |
| TELSTRA CORP LTD             | 986    | 986    | 334         | 28,368  | 電気通信サービス   |
| AMP LTD                      | 665    | 668    | 346         | 29,367  | 金融         |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  | 114    | 103    | 222         | 18,855  | 素材         |
| MACQUARIE GROUP LTD          | 72.84  | 76.84  | 766         | 65,064  | 金融         |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 126    | 126    | 297         | 25,236  | 一般消費財・サービス |
| BANK OF QUEENSLAND LTD       | 91     | 91     | 118         | 10,063  | 金融         |
| CSL LTD                      | 106    | 106    | 1,547       | 131,317 | ヘルスケア      |
| WESFARMERS LTD               | 267.45 | 264.95 | 1,157       | 98,197  | 生活必需品      |
| COCHLEAR LTD                 | 14     | 14     | 257         | 21,826  | ヘルスケア      |
| BLUESCOPE STEEL LTD          | —      | 134    | 186         | 15,842  | 素材         |
| SUNCORP GROUP LTD            | 312    | 297    | 424         | 35,994  | 金融         |
| BORAL LTD                    | 227    | 277    | 210         | 17,843  | 素材         |
| BORAL LTD-RTS                | 102.25 | —      | —           | —       | その他        |
| ASX LTD                      | 42     | 47     | 269         | 22,868  | 金融         |
| COMPUTERSHARE LTD            | 139    | 104    | 172         | 14,598  | 情報技術       |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD   | 140    | 140    | 56          | 4,776   | 一般消費財・サービス |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 549    | 549    | 396         | 33,687  | 金融         |
| SONIC HEALTHCARE LTD         | 95     | 95     | 212         | 18,020  | ヘルスケア      |
| TRANSURBAN GROUP             | 478    | —      | —           | —       | 資本財・サービス   |
| CHALLENGER LTD               | 122    | 139    | 194         | 16,515  | 金融         |
| SYDNEY AIRPORT               | 251    | —      | —           | —       | 資本財・サービス   |
| TATTS GROUP LTD              | 369    | 305    | 132         | 11,234  | 一般消費財・サービス |
| AGL ENERGY LTD               | 152    | 155    | 392         | 33,321  | 公益事業       |
| BRAMBLES LTD                 | 373    | 373    | 382         | 32,447  | 資本財・サービス   |
| APA GROUP                    | 267    | —      | —           | —       | 公益事業       |
| DUET GROUP                   | 500    | —      | —           | —       | その他        |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L | —      | 14     | 62          | 5,340   | 一般消費財・サービス |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       | 33     | 33     | 230         | 19,520  | ヘルスケア      |
| TPG TELECOM LTD              | 65     | 87     | 51          | 4,348   | 電気通信サービス   |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘 柄                          |  | 期 首                      |                    | 期 当                |             | 期 末        |            | 業 種 等 |
|------------------------------|--|--------------------------|--------------------|--------------------|-------------|------------|------------|-------|
|                              |  | 株 数                      | 株 数                | 評 価 額              |             |            |            |       |
|                              |  |                          |                    | 外貨建金額              | 邦貨換算金額      |            |            |       |
| REA GROUP LTD                |  | 百株<br>12                 | 百株<br>12           | 千オーストラリア・ドル<br>96  | 千円<br>8,160 | 情報技術       |            |       |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L |  | 14                       | 14                 | 65                 | 5,571       | 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<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 18,405.06<br>63 銘柄 | 16,427.31<br>58 銘柄 | 27,144      | 2,303,720  |            |       |
| (香港)                         |  |                          | 百株                 | 百株                 | 千香港ドル       | 千円         |            |       |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD    |  |                          | 330                | 330                | 2,211       | 31,727     | 公益事業       |       |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L |  |                          | 550                | 550                | 3,187       | 45,737     | 一般消費財・サービス |       |
| MTR CORP                     |  |                          | 345                | 345                | 1,585       | 22,748     | 資本財・サービス   |       |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      |  |                          | 350                | 340                | 4,358       | 62,548     | 不動産        |       |
| SINO LAND CO                 |  |                          | 880                | 740                | 1,025       | 14,717     | 不動産        |       |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    |  |                          | 631.69             | 631.69             | 6,149       | 88,245     | 資本財・サービス   |       |
| WHARF HOLDINGS LTD           |  |                          | 320                | 280                | 687         | 9,864      | 不動産        |       |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A     |  |                          | 125                | 125                | 941         | 13,506     | 不動産        |       |
| FIRST PACIFIC CO             |  |                          | —                  | 560                | 322         | 4,620      | 金融         |       |
| CLP HOLDINGS LTD             |  |                          | 425                | 380                | 3,085       | 44,278     | 公益事業       |       |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS       |  |                          | 330                | —                  | —           | —          | 資本財・サービス   |       |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT   |  |                          | 283.86             | 279.24             | 1,442       | 20,696     | 不動産        |       |
| HANG LUNG GROUP LTD          |  |                          | —                  | 210                | 567         | 8,136      | 不動産        |       |
| HONG KONG & CHINA GAS        |  |                          | 1,811.42           | 1,912.56           | 2,922       | 41,936     | 公益事業       |       |
| HANG SENG BANK LTD           |  |                          | 179                | 179                | 3,399       | 48,778     | 金融         |       |
| WHEELOCK & CO LTD            |  |                          | 250                | 200                | 1,066       | 15,297     | 不動産        |       |
| NEW WORLD DEVELOPMENT        |  |                          | 1,290              | 1,330              | 1,497       | 21,490     | 不動産        |       |
| WH GROUP LTD                 |  |                          | 1,350              | 1,945              | 1,624       | 23,305     | 生活必需品      |       |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  |  |                          | 273                | 273                | 6,552       | 94,021     | 金融         |       |
| LI & FUNG LTD                |  |                          | 1,320              | 1,320              | 456         | 6,553      | 一般消費財・サービス |       |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD     |  |                          | 520                | 460                | 843         | 12,106     | 不動産        |       |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY       |  |                          | 65                 | 58                 | 676         | 9,704      | 情報技術       |       |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG     |  |                          | 210                | 165                | 462         | 6,641      | 一般消費財・サービス |       |
| NWS HOLDINGS LTD             |  |                          | 465                | 355                | 491         | 7,050      | 資本財・サービス   |       |
| KERRY PROPERTIES LTD         |  |                          | 180                | 145                | 500         | 7,178      | 不動産        |       |
| BANK OF EAST ASIA LTD        |  |                          | 290.4              | 290.4              | 974         | 13,981     | 金融         |       |
| HYSAN DEVELOPMENT CO         |  |                          | 140                | 140                | 560         | 8,036      | 不動産        |       |
| SJM HOLDINGS LTD             |  |                          | 470                | 470                | 297         | 4,276      | 一般消費財・サービス |       |
| SWIRE PROPERTIES LTD         |  |                          | 300                | 262                | 687         | 9,869      | 不動産        |       |
| CK ASSET HOLDINGS LTD        |  |                          | 641.69             | 616.69             | 4,030       | 57,831     | 不動産        |       |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L |  |                          | 150                | 150                | 1,007       | 14,454     | 公益事業       |       |
| PCCW LTD                     |  |                          | 950                | 950                | 437         | 6,284      | 電気通信サービス   |       |
| AIA GROUP LTD                |  |                          | 2,830              | 2,812              | 18,545      | 266,122    | 金融         |       |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT |  |                          | —                  | 280                | 1,334       | 19,145     | 不動産        |       |
| SANDS CHINA LTD              |  |                          | 572                | 572                | 2,196       | 31,519     | 一般消費財・サービス |       |
| SHANGRI-LA ASIA LTD          |  |                          | 300                | 300                | 541         | 7,774      | 一般消費財・サービス |       |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD |  |                          | 315                | 315                | 1,417       | 20,341     | 一般消費財・サービス |       |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD       |  |                          | 200                | 200                | 403         | 5,783      | 一般消費財・サービス |       |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD   |  |                          | 875                | 875                | 3,403       | 48,843     | 金融         |       |
| WYNN MACAU LTD               |  |                          | 380                | 380                | 891         | 12,787     | 一般消費財・サービス |       |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS     |  |                          | 570                | —                  | —           | —          | 電気通信サービス   |       |
| 香 港 ド ル 通 貨 計                |  | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 21,468.06<br>38 銘柄 | 21,726.58<br>39 銘柄 | 82,783      | 1,187,943  |            |       |
| (シンガポール)                     |  |                          | 百株                 | 百株                 | 千シンガポール・ドル  | 千円         |            |       |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD     |  |                          | 300                | 313                | 814         | 67,752     | 金融         |       |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       |  |                          | 415                | 415                | 1,023       | 85,135     | 金融         |       |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       |  |                          | 124.7              | 124.7              | 131         | 10,944     | 資本財・サービス   |       |

| 銘柄                           |                  | 期首               |                  | 期末           |                   | 業種等        |
|------------------------------|------------------|------------------|------------------|--------------|-------------------|------------|
|                              |                  | 株数               | 株数               | 評価額          |                   |            |
|                              |                  |                  |                  | 外貨建金額        | 邦貨換算金額            |            |
|                              |                  | 百株               | 百株               | 千シンガポール・ドル   | 千円                |            |
| KEPPEL CORP LTD              |                  | 345              | 345              | 265          | 22,128            | 資本財・サービス   |
| UOL GROUP LTD                |                  | 132              | 132              | 116          | 9,652             | 不動産        |
| CITY DEVELOPMENTS LTD        |                  | 112              | 112              | 134          | 11,208            | 不動産        |
| CAPITALAND LTD               |                  | 590              | 590              | 207          | 17,276            | 不動産        |
| YANGZIJUANG SHIPBUILDING     |                  | —                | 420              | 64           | 5,345             | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD |                  | 410              | 410              | 111          | 9,311             | 一般消費財・サービス |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD |                  | 30               | 23               | 91           | 7,645             | 一般消費財・サービス |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP |                  | 742              | 742              | 912          | 75,924            | 金融         |
| GENTING SINGAPORE PLC        |                  | 1,530            | 1,530            | 208          | 17,310            | 一般消費財・サービス |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS |                  | 1,886.5          | 1,886.5          | 705          | 58,694            | 電気通信サービス   |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING   |                  | 350              | 350              | 113          | 9,462             | 資本財・サービス   |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD      |                  | 290              | 227              | 69           | 5,778             | 資本財・サービス   |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD    |                  | 2,194            | 1,644            | 62           | 5,197             | 生活必需品      |
| SATS LTD                     |                  | —                | 160              | 83           | 6,921             | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       |                  | 190              | 190              | 141          | 11,807            | 金融         |
| COMFORTDELGRO CORP LTD       |                  | 468              | 468              | 95           | 7,942             | 資本財・サービス   |
| STARHUB LTD                  |                  | 160              | 160              | 46           | 3,833             | 電気通信サービス   |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     |                  | 560              | 372              | 117          | 9,779             | 生活必需品      |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L |                  | 690              | 630              | 210          | 17,504            | 不動産        |
| シンガポール・ドル通貨計                 | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 11,519.2<br>20銘柄 | 11,244.2<br>22銘柄 | 5,728        | 476,557<br><0.5%> |            |
| (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          |                  | 260              | 260              | 74           | 5,681             | 公益事業       |
| SPARK NEW ZEALAND LTD        |                  | 526.89           | 526.89           | 189          | 14,504            | 電気通信サービス   |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    |                  | 234              | 234              | 152          | 11,698            | 資本財・サービス   |
| CONTACT ENERGY LTD           |                  | 130              | 130              | 71           | 5,502             | 公益事業       |
| FLETCHER BUILDING LTD        |                  | 201              | 201              | 137          | 10,557            | 素材         |
| RYMAN HEALTHCARE LTD         |                  | 53               | 88               | 91           | 7,017             | ヘルスケア      |
| ニュージーランド・ドル通貨計               | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,404.89<br>6銘柄  | 1,439.89<br>6銘柄  | 716          | 54,963<br><0.1%>  |            |
| (イギリス)                       |                  | 百株               | 百株               | 千イギリス・ポンド    | 千円                |            |
| MERLIN ENTERTAINMENT         |                  | 163              | 163              | 58           | 8,720             | 一般消費財・サービス |
| TUI AG-DI                    |                  | 117.47           | 102.47           | 137          | 20,734            | 一般消費財・サービス |
| BP PLC                       |                  | 4,363            | 4,607            | 2,278        | 342,476           | エネルギー      |
| UNILEVER PLC                 |                  | 301.1            | 301.1            | 1,269        | 190,834           | 生活必需品      |
| BARCLAYS PLC                 |                  | 3,975            | 3,955            | 768          | 115,492           | 金融         |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC     |                  | 434              | 384              | 330          | 49,702            | 資本財・サービス   |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC    |                  | 381              | 381              | 119          | 17,892            | 一般消費財・サービス |
| RANDGOLD RESOURCES LTD       |                  | 23               | 21.5             | 148          | 22,349            | 素材         |
| PRUDENTIAL PLC               |                  | 602              | 602              | 1,143        | 171,947           | 金融         |
| INMARSAT PLC                 |                  | 103              | 103              | 49           | 7,492             | 電気通信サービス   |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP |                  | 792.91           | 838.91           | 236          | 35,513            | 金融         |
| JOHNSON MATTHEY PLC          |                  | 45.64            | 45.64            | 139          | 20,987            | 素材         |
| BAE SYSTEMS PLC              |                  | 761              | 748              | 406          | 61,171            | 資本財・サービス   |
| AVIVA PLC                    |                  | 939.66           | 960.66           | 488          | 73,507            | 金融         |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          |                  | 1,150.02         | 1,145.02         | 1,497        | 225,061           | ヘルスケア      |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL    |                  | —                | 100              | 249          | 37,552            | 情報技術       |
| WORLDPAY GROUP PLC           |                  | 427              | 471              | 196          | 29,596            | 情報技術       |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC |                  | 80               | 80               | 43           | 6,494             | ヘルスケア      |
| AUTO TRADER GROUP PLC        |                  | 252              | 224              | 75           | 11,364            | 情報技術       |
| DCC PLC                      |                  | 20               | 20               | 144          | 21,767            | 資本財・サービス   |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITLE |                  | 19,964           | —                | —            | —                 | その他        |

外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 株数        | 株数        | 期末        |         | 業種等        |
|------------------------------|-----------|-----------|-----------|---------|------------|
|                              |           |           | 評価額       |         |            |
|                              |           |           | 外貨建金額     | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株        | 百株        | 千イギリス・ポンド | 千円      |            |
| CONVATEC GROUP PLC           | —         | 330       | 63        | 9,480   | ヘルスケア      |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS- ENTITL | —         | 17,664    | 1         | 265     | その他        |
| ROYAL MAIL PLC               | 224       | 224       | 97        | 14,708  | 資本財・サービス   |
| RELX PLC                     | 256.46    | 248.46    | 434       | 65,364  | 資本財・サービス   |
| DIAGEO PLC                   | 594       | 586       | 1,519     | 228,470 | 生活必需品      |
| RIO TINTO PLC                | 291.5     | 287       | 1,009     | 151,783 | 素材         |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 783       | 779       | 583       | 87,713  | 金融         |
| TESCO PLC                    | 1,911     | 1,911     | 378       | 56,881  | 生活必需品      |
| FRESNILLO PLC                | 50        | 50        | 65        | 9,793   | 素材         |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 215       | 203       | 266       | 40,007  | ヘルスケア      |
| GLENCORE PLC                 | 2,909.25  | 2,851.25  | 976       | 146,805 | 素材         |
| WOOD GROUP (JOHN) PLC        | —         | 162       | 115       | 17,364  | エネルギー      |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 57        | 65        | 103       | 15,614  | 金融         |
| SMITHS GROUP PLC             | 93.33     | 93.33     | 139       | 21,017  | 資本財・サービス   |
| BABCOCK INTL GROUP PLC       | 61        | 61        | 42        | 6,405   | 資本財・サービス   |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  | 339.83    | 310.83    | 113       | 17,017  | 金融         |
| DIXONS CARPHONE PLC          | 248       | 248       | 40        | 6,136   | 一般消費財・サービス |
| PEARSON PLC                  | 188.63    | 188.63    | 133       | 20,076  | 一般消費財・サービス |
| SAINSBURY (J) PLC            | 381.25    | 381.25    | 89        | 13,503  | 生活必需品      |
| NEXT PLC                     | 33        | 33        | 148       | 22,338  | 一般消費財・サービス |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 739       | 739       | 144       | 21,796  | 一般消費財・サービス |
| WHITBREAD PLC                | 43.11     | 43.11     | 156       | 23,550  | 一般消費財・サービス |
| IMI PLC                      | 58.5      | 66.5      | 84        | 12,746  | 資本財・サービス   |
| BUNZL PLC                    | 77.55     | 77.55     | 163       | 24,575  | 資本財・サービス   |
| ABERDEEN ASSET MGMT PLC      | 206       | —         | —         | —       | その他        |
| GKN PLC                      | 406       | 406       | 126       | 18,999  | 一般消費財・サービス |
| VODAFONE GROUP PLC           | 6,261.83  | 6,236.83  | 1,404     | 211,190 | 電気通信サービス   |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      | 29.93     | 29.93     | 128       | 19,329  | 素材         |
| KINGFISHER PLC               | 519.11    | 519.11    | 174       | 26,259  | 一般消費財・サービス |
| WPP PLC                      | 298       | 298       | 390       | 58,685  | 一般消費財・サービス |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 159.27    | 159.27    | 129       | 19,393  | 公益事業       |
| SEVERN TRENT PLC             | 57.33     | 57.33     | 122       | 18,348  | 公益事業       |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 149       | 157       | 1,023     | 153,836 | 生活必需品      |
| ST JAMES'S PLACE PLC         | 119       | 119       | 144       | 21,681  | 金融         |
| SCHRODERS PLC                | 32        | 28        | 96        | 14,542  | 金融         |
| TATE & LYLE PLC              | 101       | 114       | 76        | 11,447  | 生活必需品      |
| SSE PLC                      | 238       | 239       | 325       | 48,935  | 公益事業       |
| WEIR GROUP PLC/THE           | 48        | 54        | 108       | 16,268  | 資本財・サービス   |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 227       | 227       | 138       | 20,782  | 一般消費財・サービス |
| ASTRAZENECA PLC              | 298       | 297.5     | 1,457     | 219,143 | ヘルスケア      |
| FERGUSON PLC                 | 59.65     | 59.65     | 319       | 48,019  | 資本財・サービス   |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 1,436     | 1,381     | 370       | 55,721  | 金融         |
| 3I GROUP PLC                 | 229.91    | 229.91    | 210       | 31,641  | 金融         |
| SKY PLC                      | 248       | 245       | 229       | 34,436  | 一般消費財・サービス |
| ASHTED GROUP PLC             | 122       | 114       | 219       | 33,058  | 資本財・サービス   |
| SAGE GROUP PLC/THE           | 261.14    | 256.14    | 199       | 29,995  | 情報技術       |
| NATIONAL GRID PLC            | 888.28    | 802.34    | 706       | 106,141 | 公益事業       |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 15,039.65 | 16,729.65 | 1,122     | 168,754 | 金融         |
| RSA INSURANCE GROUP PLC      | 242.6     | 242.6     | 147       | 22,155  | 金融         |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 226.5     | 226.5     | 689       | 103,715 | 生活必需品      |
| CENTRICA PLC                 | 1,283.6   | 1,283.6   | 183       | 27,555  | 公益事業       |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | 30        | 30        | 115       | 17,327  | 一般消費財・サービス |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC      | 36.5      | 36.5      | 32        | 4,856   | 金融         |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 435.6     | 536.6     | 2,576     | 387,363 | 生活必需品      |

| 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        | 千イギリス・ポンド   | 千円      |            |
| NEX GROUP PLC                |  | 120          | —         | —           | —       | 金融         |
| BHP BILLITON PLC             |  | 501.77       | 495.77    | 669         | 100,614 | 素材         |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC |  | 85           | 81        | 243         | 36,676  | 生活必需品      |
| HSBC HOLDINGS PLC            |  | 4,633        | 4,695     | 3,489       | 524,550 | 金融         |
| SHIRE PLC                    |  | 210.74       | 209.74    | 779         | 117,182 | ヘルスケア      |
| OLD MUTUAL PLC               |  | 1,170.25     | 1,170.25  | 234         | 35,272  | 金融         |
| ANGLO AMERICAN PLC           |  | 334.83       | 306.83    | 422         | 63,469  | 素材         |
| MONDI PLC                    |  | 83           | 83        | 146         | 22,072  | 素材         |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     |  | 509          | 509       | 111         | 16,711  | 生活必需品      |
| CARNIVAL PLC                 |  | 45.11        | 45.11     | 219         | 32,950  | 一般消費財・サービス |
| EASYJET PLC                  |  | 35           | 35        | 49          | 7,403   | 資本財・サービス   |
| COMPASS GROUP PLC            |  | 388.41       | 373.89    | 566         | 85,153  | 一般消費財・サービス |
| PERSIMMON PLC                |  | 75.5         | 70.5      | 182         | 27,460  | 一般消費財・サービス |
| BT GROUP PLC                 |  | 2,000        | 1,966     | 502         | 75,483  | 電気通信サービス   |
| COCA-COLA HBC AG-DI          |  | 44           | 44        | 105         | 15,788  | 生活必需品      |
| WILLIAM HILL PLC             |  | 192          | —         | —           | —       | 一般消費財・サービス |
| BURBERRY GROUP PLC           |  | 104.89       | 104.89    | 180         | 27,184  | 一般消費財・サービス |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU |  | 44.77        | 42.86     | 187         | 28,201  | 一般消費財・サービス |
| CAPITA PLC                   |  | 150.9        | 150.9     | 74          | 11,224  | 資本財・サービス   |
| TRAVIS PERKINS PLC           |  | 59           | 59        | 93          | 14,066  | 資本財・サービス   |
| INTERTEK GROUP PLC           |  | 38           | 38        | 198         | 29,848  | 資本財・サービス   |
| ITV PLC                      |  | 868          | 868       | 137         | 20,669  | 一般消費財・サービス |
| PETROFAC LTD                 |  | 56           | —         | —           | —       | エネルギー      |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  |  | 75.49        | 71.99     | 273         | 41,178  | 金融         |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  |  | 1,000        | 1,043     | 2,467       | 370,975 | エネルギー      |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  |  | 881.18       | 872.18    | 2,106       | 316,642 | エネルギー      |
| MEGGITT PLC                  |  | 177          | 177       | 86          | 12,963  | 資本財・サービス   |
| G4S PLC                      |  | 346          | 346       | 88          | 13,341  | 資本財・サービス   |
| COBHAM PLC                   |  | 386          | 556       | 71          | 10,765  | 資本財・サービス   |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    |  | 33           | 33        | 33          | 5,099   | ヘルスケア      |
| ADMIRAL GROUP PLC            |  | 52           | 45        | 86          | 12,995  | 金融         |
| INVESTEC PLC                 |  | 145          | 160       | 82          | 12,447  | 金融         |
| ANTOFAGASTA PLC              |  | 86           | 98        | 90          | 13,568  | 素材         |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC   |  | 454.63       | 633.57    | 270         | 40,593  | 金融         |
| EXPERIAN PLC                 |  | 230.54       | 220.54    | 343         | 51,653  | 資本財・サービス   |
| イギリス・ポンド通貨計                  |  | 株 数、金 額      | 89,754.12 | 89,576.69   | 44,221  | 6,647,873  |
|                              |  | 銘柄 数 < 比 率 > | 106 銘柄    | 105 銘柄      |         | <7.0%>     |
| (イスラエル)                      |  | 百株           | 百株        | 千イスラエル・シェケル | 千円      |            |
| AZRIELI GROUP LTD            |  | 10           | 10        | 186         | 5,970   | 不動産        |
| FRUTAROM                     |  | —            | 9         | 270         | 8,660   | 素材         |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO |  | 564          | 483       | 247         | 7,913   | 電気通信サービス   |
| ISRAEL CHEMICALS LTD         |  | 140          | 140       | 196         | 6,268   | 素材         |
| ELBIT SYSTEMS LTD            |  | —            | 6         | 296         | 9,469   | 資本財・サービス   |
| BANK HAPOALIM BM             |  | 265          | 245       | 585         | 18,725  | 金融         |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         |  | 376          | 334       | 654         | 20,935  | 金融         |
| NICE LTD                     |  | 17           | 14        | 427         | 13,664  | 情報技術       |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     |  | —            | 30        | 189         | 6,063   | 金融         |
| イスラエル・シェケル通貨計                |  | 株 数、金 額      | 1,372     | 1,271       | 3,054   | 97,670     |
|                              |  | 銘柄 数 < 比 率 > | 6 銘柄      | 9 銘柄        |         | <0.1%>     |
| (スイス)                        |  | 百株           | 百株        | 千スイス・フラン    | 千円      |            |
| DUFREY AG-REG                |  | 10.5         | 8.5       | 120         | 13,719  | 一般消費財・サービス |
| UBS GROUP AG-REG             |  | 860          | 855       | 1,454       | 165,549 | 金融         |



外国株式インデックスマザーファンド

| 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               | 千スイス・フラン         | 千円                            |                    |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    |  | 2                | 2                | 129              | 14,729                        | 素材                 |
| ADECCO GROUP AG-REG          |  | 40               | 39               | 289              | 32,917                        | 資本財・サービス           |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN |  | 165              | 164.8            | 4,083            | 464,852                       | ヘルスケア              |
| PARGESA HOLDING SA-BR        |  | 8                | 9.5              | 79               | 9,051                         | 金融                 |
| SIKA AG-BR                   |  | 0.54             | 0.5              | 378              | 43,113                        | 素材                 |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  |  | 0.02             | 0.02             | 135              | 15,418                        | 生活必需品              |
| ABB LTD-REG                  |  | 439              | 464              | 1,165            | 132,676                       | 資本財・サービス           |
| ARYZTA AG                    |  | 21               | —                | —                | —                             | 生活必需品              |
| SWISS RE AG                  |  | 78               | 75.5             | 701              | 79,796                        | 金融                 |
| NESTLE SA-REG                |  | 727              | 725.5            | 6,163            | 701,548                       | 生活必需品              |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    |  | 4.2              | 4.2              | 281              | 32,031                        | 金融                 |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  |  | 10               | 9.7              | 215              | 24,567                        | 資本財・サービス           |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   |  | 435.2            | 561.2            | 917              | 104,382                       | 金融                 |
| JULIUS BAER GROUP LTD        |  | 52               | 52               | 296              | 33,798                        | 金融                 |
| SGS SA-REG                   |  | 1.3              | 1.3              | 312              | 35,544                        | 資本財・サービス           |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG     |  | 5                | 5                | 108              | 12,367                        | 資本財・サービス           |
| VIFOR PHARMA AG              |  | 0.9              | 12               | 148              | 16,924                        | ヘルスケア              |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       |  | 7.5              | 7.4              | 264              | 30,164                        | 一般消費財・サービス         |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    |  | 35.12            | 35.22            | 1,041            | 118,508                       | 金融                 |
| BALOISE HOLDING AG - REG     |  | 12               | 12               | 181              | 20,639                        | 金融                 |
| NOVARTIS AG-REG              |  | 522              | 517.5            | 4,331            | 493,051                       | ヘルスケア              |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG       |  | 0.5              | 0.5              | 90               | 10,267                        | 生活必需品              |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG |  | 123.5            | 122              | 1,027            | 116,930                       | 一般消費財・サービス         |
| SWISSCOM AG-REG              |  | 5.9              | 6.2              | 319              | 36,381                        | 電気通信サービス           |
| GEBERIT AG-REG               |  | 9                | 8.5              | 362              | 41,266                        | 資本財・サービス           |
| GIVAUDAN-REG                 |  | 2.2              | 2.2              | 487              | 55,469                        | 素材                 |
| ACTELION LTD-REG             |  | 22.5             | —                | —                | —                             | その他                |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG     |  | —                | 2.2              | 160              | 18,218                        | ヘルスケア              |
| SYNGENTA AG-REG              |  | 21.62            | —                | —                | —                             | 素材                 |
| SONOVA HOLDING AG-REG        |  | 13               | 12               | 185              | 21,076                        | ヘルスケア              |
| LONZA GROUP AG-REG           |  | 13               | 17.5             | 445              | 50,716                        | ヘルスケア              |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG      |  | 11               | 13               | 90               | 10,254                        | 一般消費財・サービス         |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG        |  | 108.4            | 105.4            | 569              | 64,787                        | 素材                 |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    |  | 8                | 7.7              | 253              | 28,906                        | 金融                 |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   |  | 12.5             | 12.5             | 213              | 24,345                        | 資本財・サービス           |
| SWISS PRIME SITE-REG         |  | 16               | 16.5             | 139              | 15,917                        | 不動産                |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   |  | 0.23             | 0.23             | 131              | 14,949                        | 生活必需品              |
| スイス・フラン通貨計                   |  | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 3,803.63<br>38銘柄 | 3,888.27<br>36銘柄 | 27,276<br>3,104,842<br><3.3%> |                    |
| (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           |  |                  | 450              | 434              | 13,974                        | 249,310<br>ヘルスケア   |
| DANSKE BANK A/S              |  |                  | 163.5            | 175.5            | 4,171                         | 74,421<br>金融       |
| ISS A/S                      |  |                  | 39               | 39               | 909                           | 16,218<br>資本財・サービス |
| AP MOELLER-MAERSK A/S-A      |  |                  | 0.95             | 0.85             | 890                           | 15,891<br>資本財・サービス |
| H LUNDBECK A/S               |  |                  | —                | 17               | 526                           | 9,389<br>ヘルスケア     |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      |  |                  | 52               | 50               | 1,959                         | 34,957<br>資本財・サービス |
| TDC A/S                      |  |                  | 193              | 193              | 726                           | 12,959<br>電気通信サービス |
| CARLSBERG AS-B               |  |                  | 24.5             | 24.5             | 1,795                         | 32,037<br>生活必需品    |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES       |  |                  | 55               | 52               | 1,730                         | 30,873<br>素材       |
| COLOPLAST-B                  |  |                  | 28               | 28               | 1,374                         | 24,526<br>ヘルスケア    |
| DSV A/S                      |  |                  | 46               | 45               | 2,151                         | 38,373<br>資本財・サービス |
| WILLIAM DEMANT HOLDING       |  |                  | 33.75            | 26.75            | 462                           | 8,251<br>ヘルスケア     |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       |  |                  | 1.6              | 1.5              | 1,635                         | 29,168<br>資本財・サービス |

| 銘 柄                          |                          | 期 首               | 当                 | 期 末          |                   | 業 種 等      |
|------------------------------|--------------------------|-------------------|-------------------|--------------|-------------------|------------|
|                              |                          | 株 数               | 株 数               | 評 価 額        |                   |            |
|                              |                          |                   |                   | 外貨建金額        | 邦貨換算金額            |            |
|                              |                          | 百株                | 百株                | 千デンマーク・クローネ  | 千円                |            |
| TRYG A/S                     |                          | —                 | 25                | 387          | 6,913             | 金融         |
| PANDORA A/S                  |                          | 26.5              | 25.5              | 1,550        | 27,659            | 一般消費財・サービス |
| CHR HANSEN HOLDING A/S       |                          | 23.5              | 23.5              | 1,297        | 23,142            | 素材         |
| GENMAB A/S                   |                          | 13                | 13                | 1,560        | 27,830            | ヘルスケア      |
| ORSTED A/S                   |                          | —                 | 44.5              | 1,582        | 28,238            | 公益事業       |
| デンマーク・クローネ通貨計                | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 1,150.3<br>15 銘柄  | 1,218.6<br>18 銘柄  | 38,686       | 690,163<br><0.7%> |            |
| (ノルウェー)                      |                          | 百株                | 百株                | 千ノルウェー・クローネ  | 千円                |            |
| NORSK HYDRO ASA              |                          | 334               | 306               | 1,811        | 24,600            | 素材         |
| DNB ASA                      |                          | 225.5             | 225.5             | 3,418        | 46,424            | 金融         |
| ORKLA ASA                    |                          | 190.5             | 190.5             | 1,581        | 21,472            | 生活必需品      |
| TELENOR ASA                  |                          | 178               | 180               | 3,312        | 44,976            | 電気通信サービス   |
| STATOIL ASA                  |                          | 261.73            | 260.73            | 4,341        | 58,952            | エネルギー      |
| SCHIBSTED ASA-CL A           |                          | 15                | 15                | 338          | 4,595             | 一般消費財・サービス |
| YARA INTERNATIONAL ASA       |                          | 41.6              | 41.6              | 1,550        | 21,049            | 素材         |
| MARINE HARVEST               |                          | 87                | 99                | 1,402        | 19,050            | 生活必需品      |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA    |                          | 48.5              | 48.5              | 738          | 10,030            | 金融         |
| SCHIBSTED ASA-B SHS          |                          | 18                | 18                | 377          | 5,121             | 一般消費財・サービス |
| ノルウェー・クローネ通貨計                | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 1,399.83<br>10 銘柄 | 1,384.83<br>10 銘柄 | 18,871       | 256,273<br><0.3%> |            |
| (スウェーデン)                     |                          | 百株                | 百株                | 千スウェーデン・クローネ | 千円                |            |
| ICA GRUPPEN AB               |                          | 19                | 19                | 573          | 7,667             | 生活必需品      |
| ERICSSON LM-B SHS            |                          | 722.3             | 710.3             | 3,778        | 50,560            | 情報技術       |
| VOLVO AB-B SHS               |                          | 345               | 366               | 5,793        | 77,520            | 資本財・サービス   |
| MILLICOM INTL CELLULAR-SDR   |                          | 15                | 15                | 804          | 10,757            | 電気通信サービス   |
| SKF AB-B SHARES              |                          | 86.5              | 87.5              | 1,689        | 22,607            | 資本財・サービス   |
| ELECTROLUX AB-SER B          |                          | 54.5              | 54.5              | 1,491        | 19,951            | 一般消費財・サービス |
| NORDEA BANK AB               |                          | 706.5             | 708.5             | 6,950        | 92,996            | 金融         |
| SWEDISH MATCH AB             |                          | 45.5              | 41.5              | 1,306        | 17,479            | 生活必需品      |
| TELE2 AB-B SHS               |                          | 89.5              | 89.5              | 959          | 12,837            | 電気通信サービス   |
| GETINGE AB-B SHS             |                          | 47                | 56                | 854          | 11,434            | ヘルスケア      |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A |                          | 341.5             | 350.5             | 3,462        | 46,334            | 金融         |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  |                          | 352               | 352               | 4,026        | 53,879            | 金融         |
| SWEDBANK AB - A SHARES       |                          | 213               | 209               | 4,165        | 55,732            | 金融         |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    |                          | 217               | 226               | 4,402        | 58,905            | 一般消費財・サービス |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B   |                          | 141               | —                 | —            | —                 | 素材         |
| SKANSKA AB-B SHS             |                          | 82.5              | 76.5              | 1,394        | 18,659            | 資本財・サービス   |
| SANDVIK AB                   |                          | 244.5             | 262.5             | 3,816        | 51,068            | 資本財・サービス   |
| INVESTOR AB-B SHS            |                          | 108               | 105.5             | 4,156        | 55,616            | 金融         |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         |                          | 157               | 157               | 5,725        | 76,611            | 資本財・サービス   |
| SECURITAS AB-B SHS           |                          | 92                | 74                | 1,079        | 14,445            | 資本財・サービス   |
| TELIA CO AB                  |                          | 600               | 600               | 2,202        | 29,462            | 電気通信サービス   |
| ALFA LAVAL AB                |                          | 70                | 70                | 1,399        | 18,722            | 資本財・サービス   |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         |                          | 91                | 91                | 2,973        | 39,790            | 資本財・サービス   |
| ASSA ABLOY AB-B              |                          | 233               | 233               | 3,991        | 53,403            | 資本財・サービス   |
| LUNDBERGS AB-B SHS           |                          | —                 | 9                 | 558          | 7,472             | 金融         |
| LUNDIN PETROLEUM AB          |                          | 64                | 42                | 816          | 10,930            | エネルギー      |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B          |                          | —                 | 141               | 3,419        | 45,749            | 生活必需品      |
| BOLIDEN AB                   |                          | 60                | 65                | 1,746        | 23,368            | 素材         |
| HUSQVARNA AB-B SHS           |                          | 125.5             | 97.5              | 748          | 10,012            | 一般消費財・サービス |
| KINNEVIK AB - B              |                          | 53                | 53                | 1,424        | 19,054            | 金融         |

外国株式インデックスマザーファンド

| 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       | 千スウェーデン・クローネ | 千円        |            |
| HEXAGON AB-B SHS             |  |               | 62       | 62       | 2,548        | 34,094    | 情報技術       |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      |  |               | 35       | 40       | 816          | 10,928    | 金融         |
| スウェーデン・クローネ通貨計               |  | 株 数、金 額       | 5,472.8  | 5,464.3  | 79,077       | 1,058,055 |            |
|                              |  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 30 銘柄    | 31 銘柄    |              | <1.1%>    |            |
| ユーロ (アイルランド)                 |  |               | 百株       | 百株       | 千ユーロ         | 千円        |            |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC    |  |               | 6,618    | 220.6    | 145          | 19,278    | 金融         |
| KERRY GROUP PLC-A            |  |               | 38.5     | 38.5     | 337          | 44,796    | 生活必需品      |
| CRH PLC                      |  |               | 194      | 194      | 576          | 76,599    | 素材         |
| PADDY POWER BETFAIR PLC      |  |               | 19       | 19       | 181          | 24,153    | 一般消費財・サービス |
| 国 小 計                        |  | 株 数、金 額       | 6,869.5  | 472.1    | 1,241        | 164,828   |            |
|                              |  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4 銘柄     | 4 銘柄     |              | <0.2%>    |            |
| ユーロ (オランダ)                   |  |               | 百株       | 百株       | 千ユーロ         | 千円        |            |
| QIAGEN N. V.                 |  |               | 54.5     | 52.48    | 140          | 18,710    | ヘルスケア      |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       |  |               | 218.76   | 214.76   | 696          | 92,512    | ヘルスケア      |
| NN GROUP NV                  |  |               | 76       | 75       | 269          | 35,769    | 金融         |
| UNILEVER NV-CVA              |  |               | 383.5    | 379.5    | 1,854        | 246,261   | 生活必需品      |
| HEINEKEN NV                  |  |               | 53       | 61       | 521          | 69,258    | 生活必需品      |
| RELX NV                      |  |               | 234.19   | 227.19   | 441          | 58,686    | 資本財・サービス   |
| AEGON NV                     |  |               | 407.44   | 407.44   | 214          | 28,457    | 金融         |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N |  |               | 298.83   | 294.83   | 514          | 68,367    | 生活必需品      |
| AKZO NOBEL                   |  |               | 58       | 58       | 438          | 58,288    | 素材         |
| KONINKLIJKE DSM NV           |  |               | 44       | 43.5     | 341          | 45,374    | 素材         |
| WOLTERS KLUWER               |  |               | 69       | 69       | 299          | 39,762    | 資本財・サービス   |
| BOSKALIS WESTMINSTER         |  |               | 21       | 21       | 64           | 8,625     | 資本財・サービス   |
| ING GROEP NV                 |  |               | 918.5    | 903.5    | 1,386        | 184,190   | 金融         |
| KONINKLIJKE KPN NV           |  |               | 782.5    | 782.5    | 238          | 31,717    | 電気通信サービス   |
| ASML HOLDING NV              |  |               | 86.8     | 87.5     | 1,294        | 171,930   | 情報技術       |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA        |  |               | 54       | 88       | 218          | 28,955    | 金融         |
| VOPAK                        |  |               | 16       | 16       | 56           | 7,456     | エネルギー      |
| RANDSTAD HOLDING NV          |  |               | 30       | 28.5     | 146          | 19,394    | 資本財・サービス   |
| HEINEKEN HOLDING NV          |  |               | 23       | 26       | 209          | 27,869    | 生活必需品      |
| GEMALTO                      |  |               | 20       | 20       | 63           | 8,414     | 情報技術       |
| ALTICE NV - A                |  |               | 89       | 115      | 80           | 10,737    | 一般消費財・サービス |
| ALTICE NV - B                |  |               | 29       | 21       | 14           | 1,966     | 一般消費財・サービス |
| AIRBUS SE                    |  |               | 136      | 135.5    | 1,182        | 157,084   | 資本財・サービス   |
| EXOR NV                      |  |               | —        | 25       | 128          | 17,099    | 金融         |
| CNH INDUSTRIAL NV            |  |               | 243      | 243      | 263          | 35,016    | 資本財・サービス   |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV |  |               | 193.5    | 250.5    | 362          | 48,106    | 一般消費財・サービス |
| FERRARI NV                   |  |               | 28.35    | 28.35    | 263          | 34,959    | 一般消費財・サービス |
| 国 小 計                        |  | 株 数、金 額       | 4,567.87 | 4,674.05 | 11,708       | 1,554,973 |            |
|                              |  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 26 銘柄    | 27 銘柄    |              | <1.6%>    |            |
| ユーロ (ベルギー)                   |  |               | 百株       | 百株       | 千ユーロ         | 千円        |            |
| UCB SA                       |  |               | 27.5     | 30       | 193          | 25,702    | ヘルスケア      |
| KBC GROEP NV                 |  |               | 58       | 58       | 399          | 52,996    | 金融         |
| COLRUYT SA                   |  |               | 20       | 16       | 70           | 9,381     | 生活必需品      |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA  |  |               | 17       | 18.5     | 166          | 22,061    | 金融         |
| SOLVAY SA                    |  |               | 17       | 17       | 200          | 26,562    | 素材         |
| UMICORE                      |  |               | 22.5     | 45       | 175          | 23,287    | 素材         |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   |  |               | 179      | 178.1    | 1,742        | 231,449   | 生活必需品      |

| 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     | 千ユーロ  | 千円      |            |
| AGEAS                        |  |               | 47.9   | 41.4   | 170   | 22,587  | 金融         |
| PROXIMUS                     |  |               | 35     | 35     | 99    | 13,280  | 電気通信サービス   |
| TELENET GROUP HOLDING NV     |  |               | 12     | 12     | 69    | 9,280   | 一般消費財・サービス |
| 国 小 計                        |  | 株 数、金 額       | 435.9  | 451    | 3,287 | 436,588 |            |
|                              |  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 10 銘柄  | 10 銘柄  |       | <0.5%>  |            |
|                              |  |               | 百株     | 百株     | 千ユーロ  | 千円      |            |
| ユーロ (ルクセンブルグ)                |  |               |        |        |       |         |            |
| RTL GROUP                    |  |               | 10     | 10     | 65    | 8,708   | 一般消費財・サービス |
| ARCELORMITTAL                |  |               | 423    | 156    | 400   | 53,256  | 素材         |
| EUROFINS SCIENTIFIC          |  |               | —      | 2.7    | 136   | 18,173  | ヘルスケア      |
| SES                          |  |               | 83.5   | 83.5   | 112   | 14,876  | 一般消費財・サービス |
| TENARIS SA                   |  |               | 105.5  | 112.5  | 136   | 18,123  | エネルギー      |
| 国 小 計                        |  | 株 数、金 額       | 622    | 364.7  | 851   | 113,138 |            |
|                              |  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4 銘柄   | 5 銘柄   |       | <0.1%>  |            |
|                              |  |               | 百株     | 百株     | 千ユーロ  | 千円      |            |
| ユーロ (フランス)                   |  |               |        |        |       |         |            |
| JCDECAUX SA                  |  |               | 16     | 16     | 55    | 7,345   | 一般消費財・サービス |
| SFR GROUP SA                 |  |               | 23     | —      | —     | —       | その他        |
| TOTAL SA                     |  |               | 521.5  | 547.5  | 2,611 | 346,879 | エネルギー      |
| MICHELIN (CGDE)              |  |               | 42     | 39.5   | 483   | 64,158  | 一般消費財・サービス |
| AIR LIQUIDE SA               |  |               | 90.48  | 99.52  | 1,048 | 139,309 | 素材         |
| KERING                       |  |               | 18     | 17.9   | 672   | 89,362  | 一般消費財・サービス |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        |  |               | 132    | 132    | 956   | 127,081 | 資本財・サービス   |
| BOUYGUES SA                  |  |               | 46.5   | 50     | 215   | 28,683  | 資本財・サービス   |
| BNP PARIBAS                  |  |               | 249    | 260.5  | 1,674 | 222,424 | 金融         |
| PEUGEOT SA                   |  |               | 112.5  | 123.5  | 213   | 28,367  | 一般消費財・サービス |
| NATIXIS                      |  |               | 229.5  | 229.5  | 153   | 20,378  | 金融         |
| THALES SA                    |  |               | 25.5   | 25.5   | 214   | 28,447  | 資本財・サービス   |
| DANONE                       |  |               | 138    | 138.5  | 989   | 131,389 | 生活必需品      |
| CARREFOUR SA                 |  |               | 129    | 128    | 227   | 30,225  | 生活必需品      |
| SUEZ                         |  |               | 74.75  | 88.75  | 138   | 18,399  | 公益事業       |
| VIVENDI                      |  |               | 237.41 | 237.41 | 539   | 71,605  | 一般消費財・サービス |
| L'OREAL                      |  |               | 59.5   | 58.5   | 1,093 | 145,248 | 生活必需品      |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN    |  |               | 115    | 115    | 557   | 74,097  | 資本財・サービス   |
| LEGRAND SA                   |  |               | 63.67  | 63.17  | 395   | 52,527  | 資本財・サービス   |
| CASINO GUICHARD PERRACHON    |  |               | 13     | 13     | 66    | 8,838   | 生活必需品      |
| PERNOD RICARD SA             |  |               | 49.17  | 49.17  | 642   | 85,285  | 生活必需品      |
| SOCIETE BIC SA               |  |               | 7      | 7      | 66    | 8,854   | 資本財・サービス   |
| EURAZEO SA                   |  |               | 10.75  | 11.16  | 81    | 10,801  | 金融         |
| REXEL SA                     |  |               | 70.5   | 70.5   | 109   | 14,540  | 資本財・サービス   |
| SOCIETE GENERALE SA          |  |               | 180    | 180    | 772   | 102,543 | 金融         |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI |  |               | 65.5   | 65.6   | 1,607 | 213,539 | 一般消費財・サービス |
| ACCOR SA                     |  |               | 40     | 44     | 185   | 24,642  | 一般消費財・サービス |
| CAPGEMINI SE                 |  |               | 39     | 37.5   | 365   | 48,508  | 情報技術       |
| VALEO SA                     |  |               | 56.5   | 56.5   | 343   | 45,585  | 一般消費財・サービス |
| PUBLICIS GROUPE              |  |               | 46     | 47.5   | 266   | 35,327  | 一般消費財・サービス |
| BUREAU VERITAS SA            |  |               | 60.5   | 60.5   | 134   | 17,881  | 資本財・サービス   |
| EIFFAGE                      |  |               | 13     | 17     | 157   | 20,882  | 資本財・サービス   |
| SODEXO SA                    |  |               | 23     | 21.5   | 235   | 31,323  | 一般消費財・サービス |
| IPSEN                        |  |               | —      | 9      | 93    | 12,371  | ヘルスケア      |
| INGENICO GROUP               |  |               | 12     | 13.5   | 117   | 15,542  | 情報技術       |
| ZODIAC AEROSPACE             |  |               | 48     | 48     | 118   | 15,733  | 資本財・サービス   |

## 外国株式インデックスマザーファンド

| 銘 柄                         |                          | 期 首      |          | 期 末    |           | 業 種 等      |
|-----------------------------|--------------------------|----------|----------|--------|-----------|------------|
|                             |                          | 株 数      | 株 数      | 評 価 額  |           |            |
|                             |                          |          |          | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |            |
|                             |                          | 百株       | 百株       | 千ユーロ   | 千円        |            |
| SEB SA                      |                          | —        | 5        | 78     | 10,422    | 一般消費財・サービス |
| ESSILOR INTERNATIONAL       |                          | 49       | 48.5     | 517    | 68,728    | ヘルスケア      |
| DASSAULT AVIATION SA        |                          | —        | 0.6      | 77     | 10,342    | 資本財・サービス   |
| AXA SA                      |                          | 455      | 455      | 1,161  | 154,213   | 金融         |
| CHRISTIAN DIOR SE           |                          | 13       | —        | —      | —         | 一般消費財・サービス |
| LAGARDERE SCA               |                          | 26.5     | 26.5     | 72     | 9,601     | 一般消費財・サービス |
| TECHNIP SA                  |                          | 25.5     | —        | —      | —         | その他        |
| EDENRED                     |                          | 47.5     | 53.5     | 129    | 17,233    | 資本財・サービス   |
| RENAULT SA                  |                          | 46       | 41       | 351    | 46,714    | 一般消費財・サービス |
| HERMES INTERNATIONAL        |                          | 6.2      | 7.3      | 318    | 42,348    | 一般消費財・サービス |
| REMY COINTREAU              |                          | 5.5      | 5.5      | 60     | 8,075     | 生活必需品      |
| ATOS SE                     |                          | 21.5     | 21.5     | 265    | 35,278    | 情報技術       |
| DASSAULT SYSTEMES SA        |                          | 30.5     | 30.5     | 271    | 36,087    | 情報技術       |
| WENDEL                      |                          | 6        | 6.8      | 95     | 12,679    | 金融         |
| ORANGE                      |                          | 469      | 468      | 676    | 89,876    | 電気通信サービス   |
| ALSTOM                      |                          | 36.5     | 36.5     | 126    | 16,782    | 資本財・サービス   |
| CNP ASSURANCES              |                          | 37.5     | 37.5     | 70     | 9,427     | 金融         |
| SANOFI                      |                          | 273.75   | 263.25   | 2,026  | 269,139   | ヘルスケア      |
| VINCI SA                    |                          | 118.5    | 116.5    | 1,012  | 134,454   | 資本財・サービス   |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT        |                          | 105.5    | 114.5    | 243    | 32,397    | 公益事業       |
| CREDIT AGRICOLE SA          |                          | 257      | 270      | 382    | 50,847    | 金融         |
| ENGIE                       |                          | 341.73   | 428.73   | 634    | 84,270    | 公益事業       |
| IMERYS SA                   |                          | 9        | 9        | 69     | 9,191     | 素材         |
| EDF                         |                          | 55.5     | 127.5    | 144    | 19,134    | 公益事業       |
| SAFRAN SA                   |                          | 74       | 74       | 669    | 88,874    | 資本財・サービス   |
| ILIAD SA                    |                          | 6        | 6        | 118    | 15,706    | 電気通信サービス   |
| ARKEMA                      |                          | 15.5     | 15.5     | 158    | 21,089    | 素材         |
| ADP                         |                          | 7.5      | 7.5      | 119    | 15,817    | 資本財・サービス   |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS     |                          | 40.5     | 40.5     | 76     | 10,192    | 一般消費財・サービス |
| SCOR SE                     |                          | 41       | 41.5     | 143    | 19,023    | 金融         |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR |                          | 104.5    | 104.5    | 115    | 15,287    | 資本財・サービス   |
| BOLLORE                     |                          | 190      | 190      | 84     | 11,229    | 資本財・サービス   |
| 国 小 計                       | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 5,972.41 | 6,174.86 | 27,878 | 3,702,606 |            |
|                             |                          | 65 銘柄    | 65 銘柄    |        | <3.9%>    |            |
| ユーロ (ドイツ)                   |                          | 百株       | 百株       | 千ユーロ   | 千円        |            |
| BAYER AG-REG                |                          | 195.5    | 193.5    | 2,090  | 277,674   | ヘルスケア      |
| EVONIK INDUSTRIES AG        |                          | 38       | 38       | 118    | 15,687    | 素材         |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED |                          | 321.5    | 486.5    | 781    | 103,831   | 金融         |
| COMMERZBANK AG              |                          | 246.85   | 246.85   | 299    | 39,783    | 金融         |
| VOLKSWAGEN AG               |                          | 8        | 8        | 137    | 18,264    | 一般消費財・サービス |
| VOLKSWAGEN AG-PREF          |                          | 43.5     | 43       | 759    | 100,910   | 一般消費財・サービス |
| MAN SE                      |                          | 8.5      | 8.5      | 80     | 10,690    | 資本財・サービス   |
| SIEMENS AG-REG              |                          | 179      | 179.5    | 2,055  | 272,961   | 資本財・サービス   |
| E. ON SE                    |                          | 465      | 517      | 509    | 67,625    | 公益事業       |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG |                          | 77.5     | 78       | 660    | 87,773    | 一般消費財・サービス |
| GEA GROUP AG                |                          | 42       | 42       | 168    | 22,440    | 資本財・サービス   |
| OSRAM LICHT AG              |                          | 21.6     | 23.6     | 165    | 21,971    | 資本財・サービス   |
| CONTINENTAL AG              |                          | 25.5     | 25.5     | 560    | 74,387    | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                           |            | 期首       | 当        | 期末     |           | 業種等        |
|------------------------------|------------|----------|----------|--------|-----------|------------|
|                              |            | 株数       | 株数       | 評価額    |           |            |
|                              |            |          |          | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |            |
|                              |            | 百株       | 百株       | 千ユーロ   | 千円        |            |
| BASF SE                      |            | 216.5    | 213.5    | 1,999  | 265,487   | 素材         |
| LINDE AG                     |            | 44       | —        | —      | —         | 素材         |
| K+S AG-REG                   |            | 44       | 44       | 86     | 11,523    | 素材         |
| ALLIANZ SE-REG               |            | 106.8    | 106.5    | 2,131  | 283,026   | 金融         |
| THYSSENKRUPP AG              |            | 85       | 102      | 236    | 31,394    | 素材         |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG   |            | 42       | 42       | 477    | 63,449    | 生活必需品      |
| RWE AG                       |            | 118      | 119      | 233    | 31,024    | 公益事業       |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       |            | 50.5     | 56.5     | 162    | 21,528    | 資本財・サービス   |
| FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT |            | 9        | 9        | 75     | 10,040    | 資本財・サービス   |
| BRENNTAG AG                  |            | 36.5     | 36.5     | 190    | 25,309    | 資本財・サービス   |
| FRESENIUS SE & CO KGAA       |            | 97       | 96.5     | 584    | 77,640    | ヘルスケア      |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE |            | 27       | 30       | 165    | 21,953    | 情報技術       |
| HOCHTIEF AG                  |            | 5        | 5        | 73     | 9,734     | 資本財・サービス   |
| SAP SE                       |            | 231.42   | 229.92   | 2,192  | 291,127   | 情報技術       |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   |            | 38.7     | 36.2     | 695    | 92,404    | 金融         |
| SCHAEFFLER AG                |            | 38       | 38       | 55     | 7,355     | 一般消費財・サービス |
| ZALANDO SE                   |            | 19       | 26       | 111    | 14,848    | 一般消費財・サービス |
| HEIDELBERGCEMENT AG          |            | 33       | 35       | 312    | 41,458    | 素材         |
| KION GROUP AG                |            | —        | 16.5     | 114    | 15,142    | 資本財・サービス   |
| COVESTRO AG                  |            | 16       | 26       | 226    | 30,038    | 素材         |
| INNOGY SE                    |            | 34       | 34       | 133    | 17,746    | 公益事業       |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF   |            | 37       | 35.5     | 251    | 33,427    | 一般消費財・サービス |
| METRO AG                     |            | —        | 41       | 66     | 8,883     | 生活必需品      |
| LINDE AG - TENDER            |            | —        | 43       | 844    | 112,103   | 素材         |
| BEIERSDORF AG                |            | 23       | 23       | 226    | 30,051    | 生活必需品      |
| FUCHS PETROLUB SE -PREF      |            | 15       | 15       | 65     | 8,725     | 素材         |
| MERCK KGAA                   |            | 31       | 31       | 280    | 37,251    | ヘルスケア      |
| ADIDAS AG                    |            | 44.2     | 44.1     | 783    | 104,048   | 一般消費財・サービス |
| HENKEL AG & CO KGAA          |            | 24       | 24       | 245    | 32,655    | 生活必需品      |
| CECONOMY AG                  |            | 41       | —        | —      | —         | 一般消費財・サービス |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG      |            | 754      | 758      | 1,122  | 149,092   | 電気通信サービス   |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &  |            | 50.5     | 50.5     | 418    | 55,586    | ヘルスケア      |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES |            | 225      | 225      | 1,577  | 209,564   | 一般消費財・サービス |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     |            | 270      | 262      | 608    | 80,796    | 情報技術       |
| HANNOVER RUECK SE            |            | 14       | 14       | 155    | 20,629    | 金融         |
| DEUTSCHE POST AG-REG         |            | 231      | 226      | 900    | 119,595   | 資本財・サービス   |
| DEUTSCHE BOERSE AG           |            | —        | 44.5     | 420    | 55,808    | 金融         |
| DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER    |            | 46       | —        | —      | —         | その他        |
| PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE     |            | 50.5     | 55.5     | 150    | 19,960    | 一般消費財・サービス |
| LANXESS AG                   |            | 22       | 22       | 139    | 18,477    | 素材         |
| AXEL SPRINGER SE             |            | 10       | 12       | 79     | 10,505    | 一般消費財・サービス |
| DEUTSCHE WOHNEN SE           |            | 82       | 84       | 308    | 41,004    | 不動産        |
| SYMRISE AG                   |            | 30       | 30       | 211    | 28,057    | 素材         |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI |            | 165      | 165      | 65     | 8,721     | 電気通信サービス   |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF |            | 12       | 12       | 87     | 11,618    | 一般消費財・サービス |
| HUGO BOSS AG -ORD            |            | 16.5     | 14.5     | 99     | 13,260    | 一般消費財・サービス |
| VONOVIA SE                   |            | 109      | 109      | 425    | 56,493    | 不動産        |
| 国小計                          | 株数、金額      | 5,266.57 | 5,532.67 | 28,179 | 3,742,556 |            |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 56銘柄     | 57銘柄     |        | <3.9%>    |            |

外国株式インデックスマザーファンド

| 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              |            |
| ユーロ（ポルトガル）                   |                  | 百株                | 百株                | 千ユーロ  | 千円                  |            |
| JERONIMO MARTINS             |                  | 60                | 60                | 100   | 13,295              | 生活必需品      |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA  |                  | 495               | 495               | 143   | 19,117              | 公益事業       |
| GALP ENERGIA SGPS SA         |                  | 103.5             | 116.5             | 186   | 24,763              | エネルギー      |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数＜比率＞ | 658.5<br>3銘柄      | 671.5<br>3銘柄      | 430   | 57,176<br>＜0.1％＞    |            |
| ユーロ（スペイン）                    |                  | 百株                | 百株                | 千ユーロ  | 千円                  |            |
| TELEFONICA SA                |                  | 1,046.27          | 1,046.27          | 906   | 120,362             | 電気通信サービス   |
| ENDESA SA                    |                  | 76.5              | 76.5              | 145   | 19,293              | 公益事業       |
| BANCO POPULAR ESPANOL        |                  | 754.73            | —                 | —     | —                   | 金融         |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA |                  | 1,534.12          | 1,555.12          | 1,131 | 150,337             | 金融         |
| IBERDROLA SA                 |                  | 1,271.34          | 1,357.34          | 906   | 120,329             | 公益事業       |
| BANCO DE SABADELL SA         |                  | 1,319.09          | 1,229.09          | 210   | 27,929              | 金融         |
| BANKINTER SA                 |                  | 151               | 151               | 122   | 16,209              | 金融         |
| REPSOL SA                    |                  | 257               | 287               | 442   | 58,775              | エネルギー      |
| GRIFOLS SA                   |                  | 67                | 67                | 164   | 21,849              | ヘルスケア      |
| BANCO SANTANDER SA           |                  | 3,438.5           | 3,782.5           | 2,157 | 286,542             | 金融         |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA  |                  | 149               | 158               | 294   | 39,072              | 資本財・サービス   |
| AMADEUS IT GROUP SA          |                  | 100               | 101               | 616   | 81,864              | 情報技術       |
| GAS NATURAL SDG SA           |                  | 84.5              | 84.5              | 159   | 21,154              | 公益事業       |
| MAPFRE SA                    |                  | 214.5             | 254.5             | 72    | 9,653               | 金融         |
| CAIXABANK S. A               |                  | 748               | 816               | 330   | 43,847              | 金融         |
| CAIXABANK S. A-RTS           |                  | 748               | —                 | —     | —                   | その他        |
| ZARDOYA OTIS SA              |                  | 45.5              | —                 | —     | —                   | 資本財・サービス   |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI |                  | 180               | 152               | 105   | 14,007              | 資本財・サービス   |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV  |                  | 44.76             | 53.76             | 176   | 23,429              | 資本財・サービス   |
| AENA SME SA                  |                  | 16                | 16                | 271   | 35,996              | 資本財・サービス   |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL   |                  | 253               | 253               | 753   | 100,046             | 一般消費財・サービス |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE |                  | —                 | 56                | 59    | 7,853               | 資本財・サービス   |
| ENAGAS SA                    |                  | 54                | 54                | 132   | 17,531              | エネルギー      |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA |                  | 100               | 100               | 189   | 25,147              | 公益事業       |
| FERROVIAL SA                 |                  | 117               | 117               | 216   | 28,746              | 資本財・サービス   |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL  |                  | 157               | 157               | 62    | 8,236               | 生活必需品      |
| BANKIA SA                    |                  | 1,084.22          | 241.05            | 97    | 12,946              | 金融         |
| 国小計                          | 株数、金額<br>銘柄数＜比率＞ | 14,011.03<br>26銘柄 | 12,165.63<br>24銘柄 | 9,721 | 1,291,165<br>＜1.4％＞ |            |
| ユーロ（イタリア）                    |                  | 百株                | 百株                | 千ユーロ  | 千円                  |            |
| UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA  |                  | 217.5             | 217.5             | 41    | 5,543               | 金融         |
| PRYSMIAN SPA                 |                  | 48                | 48                | 133   | 17,747              | 資本財・サービス   |
| ASSICURAZIONI GENERALI       |                  | 278.43            | 290.43            | 441   | 58,668              | 金融         |
| SAIPEM SPA                   |                  | 1,343             | 134.3             | 46    | 6,207               | エネルギー      |
| MEDIOBANCA SPA               |                  | 146.15            | 130.15            | 123   | 16,438              | 金融         |
| UNICREDIT SPA                |                  | 1,235.69          | 473.06            | 806   | 107,057             | 金融         |
| TELECOM ITALIA SPA           |                  | 2,582.82          | 2,662.82          | 186   | 24,773              | 電気通信サービス   |
| TELECOM ITALIA-RSP           |                  | 1,349.5           | 1,349.5           | 77    | 10,278              | 電気通信サービス   |
| INTESA SANPAOLO-RSP          |                  | 210               | 210               | 55    | 7,418               | 金融         |
| INTESA SANPAOLO              |                  | 2,985.97          | 3,143.97          | 886   | 117,749             | 金融         |
| ATLANTIA SPA                 |                  | 99.07             | 106.07            | 293   | 39,021              | 資本財・サービス   |
| POSTE ITALIANE SPA           |                  | 118               | 118               | 72    | 9,630               | 金融         |



| 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            |            |
| RECORDATI SPA                |  | 百株<br>—                  | 百株<br>26               | 千ユーロ<br>97             | 千円<br>12,990      | ヘルスケア      |
| ENI SPA                      |  | 598                      | 591                    | 813                    | 108,003           | エネルギー      |
| LEONARDO SPA                 |  | 95.25                    | 95.25                  | 95                     | 12,688            | 資本財・サービス   |
| ENEL SPA                     |  | 1,778.34                 | 1,896.34               | 1,038                  | 137,889           | 公益事業       |
| SNAM SPA                     |  | 582                      | 532                    | 225                    | 29,887            | エネルギー      |
| LUXOTTICA GROUP SPA          |  | 37                       | 38.5                   | 184                    | 24,563            | 一般消費財・サービス |
| TERNA SPA                    |  | 354                      | 324                    | 167                    | 22,311            | 公益事業       |
| EXOR SPA                     |  | 25                       | —                      | —                      | —                 | 金融         |
| 国 小 計                        |  | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 14,083.72<br>19 銘柄     | 12,386.89<br>19 銘柄     | 5,789<br><0.8%>   |            |
| ユーロ (フィンランド)                 |  | 百株                       | 百株                     | 千ユーロ                   | 千円                |            |
| UPM-KYMMENE OYJ              |  | 124                      | 124                    | 318                    | 42,274            | 素材         |
| NOKIA OYJ                    |  | 1,358.5                  | 1,389.5                | 584                    | 77,691            | 情報技術       |
| WARTSILA OYJ ABP             |  | 32                       | 33.5                   | 185                    | 24,648            | 資本財・サービス   |
| STORA ENSO OYJ-R SHS         |  | 131                      | 131                    | 171                    | 22,721            | 素材         |
| METSO OYJ                    |  | 30                       | 24                     | 71                     | 9,492             | 資本財・サービス   |
| ELISA OYJ                    |  | 35.5                     | 32.5                   | 110                    | 14,645            | 電気通信サービス   |
| SAMPO OYJ-A SHS              |  | 103                      | 103.5                  | 461                    | 61,278            | 金融         |
| FORTUM OYJ                   |  | 104.5                    | 104.5                  | 183                    | 24,329            | 公益事業       |
| KONE OYJ-B                   |  | 78.5                     | 78.5                   | 341                    | 45,361            | 資本財・サービス   |
| NOKIAN RENKAAT OYJ           |  | 30                       | 26.5                   | 96                     | 12,835            | 一般消費財・サービス |
| NESTE OYJ                    |  | 29.5                     | 29.5                   | 149                    | 19,824            | エネルギー      |
| ORION OYJ-CLASS B            |  | 20.5                     | 24.5                   | 79                     | 10,516            | ヘルスケア      |
| 国 小 計                        |  | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 2,077<br>12 銘柄         | 2,101.5<br>12 銘柄       | 2,752<br><0.4%>   |            |
| ユーロ (オーストリア)                 |  | 百株                       | 百株                     | 千ユーロ                   | 千円                |            |
| OMV AG                       |  | 35.5                     | 35.5                   | 185                    | 24,573            | エネルギー      |
| ERSTE GROUP BANK AG          |  | 66.5                     | 66.5                   | 242                    | 32,267            | 金融         |
| VOESTALPINE AG               |  | 28.5                     | 28.5                   | 139                    | 18,554            | 素材         |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA |  | 24                       | 34                     | 102                    | 13,636            | 金融         |
| ANDRITZ AG                   |  | 16                       | 16                     | 74                     | 9,852             | 資本財・サービス   |
| 国 小 計                        |  | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 170.5<br>5 銘柄          | 180.5<br>5 銘柄          | 744<br><0.1%>     |            |
| ユーロ (その他)                    |  | 百株                       | 百株                     | 千ユーロ                   | 千円                |            |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  |  | 52                       | 52                     | 168                    | 22,355            | 生活必需品      |
| STMICROELECTRONICS NV        |  | 153                      | 146                    | 275                    | 36,540            | 情報技術       |
| 国 小 計                        |  | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 205<br>2 銘柄            | 198<br>2 銘柄            | 443<br><0.1%>     |            |
| ユ ー ロ 通 貨 計                  |  | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 54,940<br>232 銘柄       | 45,373.4<br>233 銘柄     | 93,029<br><13.0%> |            |
| フ ァ ン ド 合 計                  |  | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 291,354.98<br>1,238 銘柄 | 278,979.17<br>1,256 銘柄 | —<br><95.5%>      |            |

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

| 銘 柄                          | 期 首                      | 当 期              | 期 末                   |                   |
|------------------------------|--------------------------|------------------|-----------------------|-------------------|
|                              | 口 数                      | 口 数              | 評 価                   | 額                 |
|                              | 千口                       | 千口               | 外 貨 建 金 額<br>千アメリカ・ドル | 邦 貨 換 算 金 額<br>千円 |
| (アメリカ)                       |                          |                  |                       |                   |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 3.197                    | 3.197            | 581                   | 65,211            |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 7.187                    | 7.137            | 1,132                 | 126,936           |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 3.6                      | 3.55             | 443                   | 49,742            |
| GGP INC                      | 13.6                     | 14.4             | 336                   | 37,756            |
| VORNADO REALTY TRUST         | 3.827                    | 3.827            | 294                   | 32,988            |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | —                        | 2.75             | 466                   | 52,309            |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 8.5                      | 8.5              | 567                   | 63,564            |
| EQUINIX INC                  | 1.608                    | 1.808            | 846                   | 94,875            |
| AMERICAN TOWER CORP          | 9.75                     | 9.75             | 1,426                 | 159,830           |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 17.293                   | 17.293           | 340                   | 38,114            |
| KIMCO REALTY CORP            | 10                       | 10               | 184                   | 20,695            |
| COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A | —                        | 12               | 147                   | 16,538            |
| VENTAS INC                   | 7.9                      | 8.3              | 531                   | 59,586            |
| WEYERHAEUSER CO              | 17.614                   | 16.964           | 600                   | 67,231            |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 7.8                      | 9                | 180                   | 20,239            |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | 6.9                      | 6.9              | 125                   | 14,102            |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 7.75                     | 9.25             | 1,043                 | 116,975           |
| IRON MOUNTAIN INC            | 5.61                     | 5.61             | 227                   | 25,470            |
| VEREIT INC                   | 22.3                     | 22.3             | 175                   | 19,614            |
| PROLOGIS INC                 | 12.262                   | 12.262           | 810                   | 90,859            |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 1.7                      | 2.1              | 266                   | 29,876            |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 2                        | 2.15             | 196                   | 22,064            |
| DUKE REALTY CORP             | 8                        | 8                | 229                   | 25,681            |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 1.48                     | 1.48             | 366                   | 41,073            |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 1.6                      | 1.6              | 211                   | 23,682            |
| WELLTOWER INC                | 8.3                      | 8.4              | 565                   | 63,325            |
| HCP INC                      | 10.7                     | 10.7             | 287                   | 32,251            |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 3.3                      | 3.3              | 147                   | 16,498            |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 1.7                      | 2.6              | 265                   | 29,788            |
| MACERICH CO/THE              | 3                        | 2.7              | 173                   | 19,431            |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 23.2                     | 26.6             | 313                   | 35,080            |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | —                        | 3.4              | 140                   | 15,760            |
| REALTY INCOME CORP           | 6                        | 6.45             | 357                   | 40,089            |
| PUBLIC STORAGE               | 3.4                      | 3.6              | 756                   | 84,814            |
| REGENCY CENTERS CORP         | 2.3                      | 3.5              | 238                   | 26,667            |
| SL GREEN REALTY CORP         | 2.25                     | 2.25             | 230                   | 25,773            |
| UDR INC                      | 6.3                      | 6.3              | 247                   | 27,784            |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 3.7                      | 4.75             | 555                   | 62,266            |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 2.75                     | 3                | 255                   | 28,592            |
| ア メ リ カ ・ ド ル 通 貨 計          | 口 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 258.378<br>36 銘柄 | 287.678<br>39 銘柄      | 16,270<br><1.9%>  |
| (カナダ)                        |                          |                  |                       |                   |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 1.5                      | 1.5              | 43                    | 3,809             |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 3                        | 3                | 62                    | 5,482             |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 3.3                      | 3.9              | 96                    | 8,444             |
| カ ナ ダ ・ ド ル 通 貨 計            | 口 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 7.8<br>3 銘柄      | 8.4<br>3 銘柄           | 203<br><0.0%>     |

| 銘柄                           |            | 期首        | 当         | 期末          |           |
|------------------------------|------------|-----------|-----------|-------------|-----------|
|                              |            | 口数        | 口数        | 評価          | 価額        |
|                              |            |           |           | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |
| (オーストラリア)                    |            | 千口        | 千口        | 千オーストラリア・ドル | 千円        |
| LENDLEASE GROUP              |            | —         | 13.3      | 214         | 18,173    |
| TRANSURBAN GROUP             |            | —         | 47.8      | 601         | 51,034    |
| SYDNEY AIRPORT               |            | —         | 25.1      | 188         | 15,976    |
| APA GROUP                    |            | —         | 26.7      | 247         | 21,028    |
| SCENTRE GROUP                |            | 121.922   | 124.222   | 525         | 44,595    |
| DEXUS                        |            | 23.95     | 23.95     | 244         | 20,753    |
| GPT GROUP                    |            | 40.06     | 44.06     | 235         | 20,005    |
| MIRVAC GROUP                 |            | 93.4      | 84.4      | 205         | 17,477    |
| STOCKLAND                    |            | 57        | 57        | 266         | 22,639    |
| WESTFIELD CORP               |            | 45.496    | 45.496    | 380         | 32,280    |
| GOODMAN GROUP                |            | 41.7      | 41.7      | 363         | 30,825    |
| VICINITY CENTRES             |            | 74.873    | 76.973    | 213         | 18,160    |
| オーストラリア・ドル通貨計                | 口数、金額      | 498.401   | 610.701   | 3,687       | 312,951   |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 8銘柄       | 12銘柄      |             | <0.3%>    |
| (香港)                         |            | 千口        | 千口        | 千香港ドル       | 千円        |
| LINK REIT                    |            | 52        | 52        | 3,658       | 52,495    |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS  |            | —         | 64.5      | 462         | 6,636     |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS     |            | —         | 87        | 860         | 12,347    |
| 香 港 ド ル 通 貨 計                | 口数、金額      | 52        | 203.5     | 4,981       | 71,478    |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 1銘柄       | 3銘柄       |             | <0.1%>    |
| (シンガポール)                     |            | 千口        | 千口        | 千シンガポール・ドル  | 千円        |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  |            | —         | 60.1      | 111         | 9,299     |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT |            | 48        | 57.4      | 150         | 12,558    |
| CAPITALAND MALL TRUST        |            | 63.2      | 63.2      | 130         | 10,830    |
| SUNTEC REIT                  |            | 53        | 53        | 106         | 8,818     |
| シンガポール・ドル通貨計                 | 口数、金額      | 164.2     | 233.7     | 498         | 41,506    |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 3銘柄       | 4銘柄       |             | <0.0%>    |
| (イギリス)                       |            | 千口        | 千口        | 千イギリス・ポンド   | 千円        |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    |            | 18.2      | 17.062    | 158         | 23,853    |
| SEGRO PLC                    |            | 19.95     | 23.75     | 130         | 19,619    |
| HAMMERSON PLC                |            | 17.4      | 19.2      | 99          | 14,907    |
| BRITISH LAND CO PLC          |            | 22.1      | 22.1      | 137         | 20,731    |
| INTU PROPERTIES PLC          |            | 21.1      | 21.1      | 41          | 6,175     |
| イギリス・ポンド通貨計                  | 口数、金額      | 98.75     | 103.212   | 567         | 85,287    |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 5銘柄       | 5銘柄       |             | <0.1%>    |
| (ユーロ (フランス))                 |            | 千口        | 千口        | 千ユーロ        | 千円        |
| UNIBAIL-RODAMCO SE           |            | 2.36      | 2.35      | 510         | 67,851    |
| ICADE                        |            | 0.75      | 0.9       | 70          | 9,421     |
| GECINA SA                    |            | 0.95      | 1.15      | 160         | 21,260    |
| KLEPIERRE                    |            | 5.2       | 5.2       | 179         | 23,902    |
| FONCIERE DES REGIONS         |            | 0.75      | 0.75      | 66          | 8,894     |
| 国 小 計                        | 口数、金額      | 10.01     | 10.35     | 988         | 131,329   |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 5銘柄       | 5銘柄       |             | <0.1%>    |
| 合 計                          | 口数、金額      | 1,089.539 | 1,457.541 | —           | 2,483,442 |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 61銘柄      | 71銘柄      |             | <2.6%>    |

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(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 E-MINI FUTURE<br>(アメリカ) | 百万円   | 百万円   |
|       |                                | 1,735 | —     |

- (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

2017年11月30日現在

| 項 目          | 当 期 末      |       |
|--------------|------------|-------|
|              | 評 価 額      | 比 率   |
|              | 千円         | %     |
| 株式           | 90,681,988 | 95.5  |
| 投資信託証券       | 2,483,442  | 2.6   |
| コール・ローン等、その他 | 1,836,446  | 1.9   |
| 投資信託財産総額     | 95,001,876 | 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＝112.05円、1カナダ・ドル＝87.10円、1オーストラリア・ドル＝84.87円、1香港ドル＝14.35円、1シンガポール・ドル＝83.19円、1ニュージーランド・ドル＝76.68円、1イギリス・ポンド＝150.33円、1イスラエル・シェケル＝31.98円、1スイス・フラン＝113.83円、1デンマーク・クローネ＝17.84円、1ノルウェー・クローネ＝13.58円、1スウェーデン・クローネ＝13.38円、1ユーロ＝132.81円です。
- (注 3) 当期末における外貨建純資産 (94,407,006千円) の投資信託財産総額 (95,001,876千円) に対する比率は、99.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

| 項 目            | 当 期 末           |
|----------------|-----------------|
| (A) 資産         | 95,502,686,695円 |
| コール・ローン等       | 940,519,417     |
| 株式（評価額）        | 90,681,988,461  |
| 投資信託証券（評価額）    | 2,483,442,333   |
| 未収入金           | 552,614,768     |
| 未収配当金          | 160,250,126     |
| 差入委託証拠金        | 683,871,590     |
| (B) 負債         | 575,358,500     |
| 未払金            | 500,889,700     |
| 未払解約金          | 74,468,800      |
| (C) 純資産総額（A－B） | 94,927,328,195  |
| 元本             | 39,734,106,968  |
| 次期繰越損益金        | 55,193,221,227  |
| (D) 受益権総口数     | 39,734,106,968口 |
| 1万口当り基準価額（C／D） | 23,891円         |

- \*期首における元本額は40,539,431,105円、当期中における追加設定元本額は5,901,304,959円、同解約元本額は6,706,629,096円です。
- \*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国株式インデックスV A565,889,975円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）18,626,936円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）281,422,814円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）32,623,332円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）908,478,453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）399,976,869円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）900,220,105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）305,036,599円、D－I's 外国株式インデックス992,761円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 175,432円、iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）391,225,801円、iFree 8資産バランス291,084,495円、D Cダイワ外国株式インデックス24,052,269,212円、ダイワ・ライフ・バランス30500,509,712円、ダイワ・ライフ・バランス50709,804,567円、ダイワ・ライフ・バランス70564,304,287円、大和D C海外株式インデックスファンド1,438,818,935円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 5,379,290円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 14,469,810円、D Cダイワ・ターゲットイヤー20403,513,286円、ダイワ世界分散バランスファンド15VA81,383円、ダイワ世界分散バランスファンド20VA162,594円、ダイワ世界分散バランスファンド25VA2,143,628円、ダイワ世界分散バランスファンド30VA8,975,878円、ダイワ世界バランスファンド40VA506,282,561円、ダイワ世界バランスファンド60VA392,714,678円、ダイワ・バランスファンド35VA3,809,894,746円、ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）179,797,597円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式498,683,806円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド44,190,165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）464,730円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス2,755,474,027円、ダイワライフスタイル2520,423,108円、ダイワライフスタイル5071,323,850円、ダイワライフスタイル7558,671,546円です。
- \*当期末の計算口数当りの純資産額は23,891円です。

## ■損益の状況

当期 自 2016年12月1日 至 2017年11月30日

| 項 目                       | 当 期             |
|---------------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益                 | 1,950,213,125円  |
| 受取配当金                     | 1,943,161,002   |
| 受取利息                      | 1,077,265       |
| その他収益金                    | 6,420,958       |
| 支払利息                      | △ 446,100       |
| (B) 有価証券売買損益              | 15,516,977,994  |
| 売買益                       | 17,875,975,167  |
| 売買損                       | △ 2,358,997,173 |
| (C) 先物取引等損益               | 202,349,358     |
| 取引益                       | 211,221,645     |
| 取引損                       | △ 8,872,287     |
| (D) その他費用                 | △ 49,387,172    |
| (E) 当期損益金 (A + B + C + D) | 17,620,153,305  |
| (F) 前期繰越損益金               | 38,466,622,365  |
| (G) 解約差損益金                | △ 7,895,848,284 |
| (H) 追加信託差損益金              | 7,002,293,841   |
| (I) 合計 (E + F + G + H)    | 55,193,221,227  |
| 次期繰越損益金 (I)               | 55,193,221,227  |

(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

## 運用報告書 第7期（決算日 2017年7月5日）

（計算期間 2016年7月6日～2017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・マザーファンドの第7期にかかる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。）<br>2. 新興国の企業のDR（預託証券）<br>3. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF（上場投資信託証券）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 運用方法   | ①主として、新興国の株式（DRを含みます。以下同じ。）（※）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運用を行ないます。<br>※効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETFに投資する場合があります。<br>②株式およびETFの組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。<br>③運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>④為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。 |
| 株式組入制限 | 無制限                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

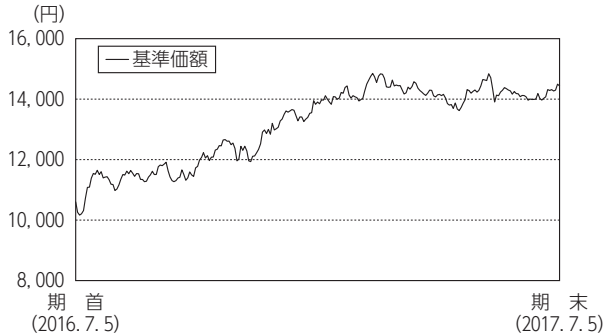
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

# ■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日              | 基準 価 額 |            | FTSE RAFI<br>エマージング<br>インデックス<br>(円換算) | 株<br>組<br>比 | 式<br>入<br>率 | 株<br>先<br>比 | 式<br>物<br>率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 |
|--------------------|--------|------------|----------------------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|--------------------|
|                    | 円      | 騰落率<br>(%) | 騰落率<br>(%)                             |             |             |             |             |                    |
| (期首) 2016年 7 月 5 日 | 10,600 | —          | 11,478                                 | —           | 90.8        | —           | —           | 6.7                |
| 7 月 末              | 11,333 | 6.9        | 12,323                                 | 7.4         | 93.2        | —           | —           | 4.6                |
| 8 月 末              | 11,615 | 9.6        | 12,618                                 | 9.9         | 93.0        | —           | —           | 4.7                |
| 9 月 末              | 11,489 | 8.4        | 12,573                                 | 9.5         | 93.0        | —           | —           | 4.7                |
| 10 月 末             | 12,495 | 17.9       | 13,681                                 | 19.2        | 93.4        | —           | —           | 4.7                |
| 11 月 末             | 12,839 | 21.1       | 13,968                                 | 21.7        | 92.2        | —           | —           | 5.9                |
| 12 月 末             | 13,551 | 27.8       | 14,784                                 | 28.8        | 90.0        | —           | —           | 6.5                |
| 2017年 1 月 末        | 14,136 | 33.4       | 15,460                                 | 34.7        | 90.5        | —           | —           | 7.3                |
| 2 月 末              | 14,390 | 35.8       | 15,769                                 | 37.4        | 91.4        | —           | —           | 6.3                |
| 3 月 末              | 14,288 | 34.8       | 15,735                                 | 37.1        | 93.0        | —           | —           | 4.4                |
| 4 月 末              | 14,195 | 33.9       | 15,566                                 | 35.6        | 93.1        | —           | —           | 4.9                |
| 5 月 末              | 14,270 | 34.6       | 15,670                                 | 36.5        | 93.3        | —           | —           | 4.5                |
| 6 月 末              | 14,268 | 34.6       | 15,700                                 | 36.8        | 92.8        | —           | —           | 5.3                |
| (期末) 2017年 7 月 5 日 | 14,435 | 36.2       | 15,859                                 | 38.2        | 91.8        | —           | —           | 5.6                |

(注 1) 騰落率は期首比。

(注 2) FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) は、FTSE International Limited の承諾を得て、FTSE RAFI エマージング インデックス (配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託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) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

## 《運用経過》

### ◆基準価額等の推移について

#### 【基準価額・騰落率】

期首：10,600円 期末：14,435円 騰落率：36.2%

#### 【基準価額の変動要因】

ベンチマークである FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) に連動させることをめざした運用を行なった結果、新興国株式がアジアを中心に全体として上昇基調だったことや、為替相場で円安が進んだことからベンチマークが上昇し、当ファンドの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、期を通じてはアジアを中心に上昇しました。新興国株式市況は、期首より、日欧での追加金融緩和への期待が高まったことなどから、リスクを取る動きが強まり上昇しました。2016年11月にトランプ氏が米国大統領選挙に勝利してからは、米国の財政支出拡大が予想されたことから米国の株高と金利上昇が進み、それを受けて新興国からの資金流出が起こり新興国株は下落しました。特に、メキシコおよびブラジル株式市場は、トランプ大統領の保護主義が経済への悪影響となることが懸念されたこともあり軟調な推移となりました。12月下旬以降は、エネルギー価格の上昇や良好な米国および中国の経済指標、F R B (米連邦準備制度理事会) の利上げペースが緩やかなものになるという見方が強まったことなどから、世界景気に対する安心感が広がり堅調に推移しました。2017年5月中旬からは、原油価格の下落や地政学リスクの上昇などにより、アジア圏を除き上値が重い展開となって期末を迎えました。

#### ○為替相場

為替相場は、期首より、米国の早期利上げ観測の後退から、米ドル安新興国通貨高の推移となりました。同時期に日銀の金融政策決定会合で政策金利が据え置かれたことが市場の失望を誘い、米ドル安円高が進行し、新興国通貨は円に対して横ばいの推移となりました。2016年11月にトランプ氏が米国大統領選挙に勝利してからは、米ドル高新興国通貨安が急激に進行しましたが、同時に米ドル高円安が進行したことから、円に対して新興国通貨高が急激に進行しました。その後は地域的な要因での変動はありましたが、米ドル安・新興国通貨高・円高傾向での推移となり、円に対してやや新興国通貨高での推移で期末を迎えました。

### ◆前期における「今後の運用方針」

主として、新興国の株式 (D R (預託証券) を含む。) に投資し、投資成果を 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うことを基本とします。また、効率性の観点から FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざす E T F (上場投資信託証券) にも一部投資します。なお、株式および E T F の組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。さらに、リバランス時等に、株式実質組入比率の維持を目的に株価指数先物取引の利用も検討します。

また、保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

### ◆ポートフォリオについて

株式組入比率 (D R、E T F、株価指数先物を含む。) は、FTSE RAFI エマージング インデックスのリバランス時や大量設定時を除き、期を通じて原則として97%以上で運用を行ないました。

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI エマージング イ



ンデックス採用銘柄の組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、D R等を組み入れることでFTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）との連動性を維持するような運用を行ないました。

また、効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすE T Fにも一部投資し、リバランス時には株価指数先物も利用しました。

◆ベンチマークとの差異について

当期の当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率は、「当期中の基準価額と市況の推移」をご参照ください。

未収配当金部分等については株式の組み入れができないため、期を通じて、株式組入比率を基本的に97～98%台で推移させました。その結果、ベンチマークの上昇に対しマイナスの乖離が発生しました。

また、配当金に対する課税分や保管費用等のコストが、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、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

《今後の運用方針》

引き続き、主として、新興国の株式（D Rを含む。）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運用を行なうことを基本とします。また、効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすE T Fにも一部投資します。なお、株式およびE T Fの組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。さらに、リバランス時等に、株式実質組入比率の維持を目的に株価指数先物取引の利用も検討します。

また、保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

■1万口当りの費用の明細

| 項 目      | 当 期   |
|----------|-------|
| 売買委託手数料  | 23円   |
| （株式）     | （ 21） |
| （先物）     | （ 1）  |
| （投資信託証券） | （ 1）  |
| 有価証券取引税  | 7     |
| （株式）     | （ 7）  |
| （投資信託証券） | （ 0）  |
| その他費用    | 76    |
| （保管費用）   | （ 64） |
| （その他）    | （ 13） |
| 合 計      | 107   |

（注1）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、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

（注2）各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

(2016年7月6日から2017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<br>21,816.7<br>( )     | 千アメリカ・ドル<br>1,500<br>( )        | 百株<br>324.07   | 千アメリカ・ドル<br>411        |
|     | 香港     | 百株<br>44,002<br>( 80)     | 千香港ドル<br>31,729<br>(△ 173)      | 百株<br>3,154    | 千香港ドル<br>2,049         |
|     | 台湾     | 百株<br>12,350<br>( 274.47) | 千台湾ドル<br>55,118<br>( 306)       | 百株<br>1,770.9  | 千台湾ドル<br>3,224         |
|     | トルコ    | 百株<br>1,284.6<br>( )      | 千トルコ・リラ<br>1,168<br>( )         | 百株<br>116.1    | 千トルコ・リラ<br>54          |
|     | メキシコ   | 百株<br>5,305.9<br>( 66.28) | 千メキシコ・ペソ<br>14,186<br>( )       | 百株<br>590      | 千メキシコ・ペソ<br>965        |
|     | チリ     | 百株<br>3,149.8<br>( 1.67)  | 千チリ・ペソ<br>60,133<br>( )         | 百株<br>181.46   | 千チリ・ペソ<br>5,418        |
|     | インド    | 百株<br>2,553<br>( 318.39)  | 千インド・ルピー<br>65,138<br>( )       | 百株<br>1,731.62 | 千インド・ルピー<br>21,555     |
|     | インドネシア | 百株<br>5,609<br>( )        | 千インドネシア・ルピア<br>3,297,999<br>( ) | 百株<br>231      | 千インドネシア・ルピア<br>247,338 |
|     | ブラジル   | 百株<br>4,220<br>( 89.47)   | 千ブラジル・レアル<br>8,083<br>(△ 1)     | 百株<br>5,583.2  | 千ブラジル・レアル<br>11,048    |
|     | マレーシア  | 百株<br>2,320<br>( )        | 千マレーシア・リンギット<br>1,804<br>( )    | 百株<br>469      | 千マレーシア・リンギット<br>276    |
| 国   | 南アフリカ  | 百株<br>1,586.5<br>( )      | 千南アフリカ・ランド<br>17,111<br>(△ 107) | 百株<br>446.84   | 千南アフリカ・ランド<br>1,819    |
|     | タイ     | 百株<br>3,917<br>( )        | 千タイ・バーツ<br>21,435<br>( )        | 百株<br>54       | 千タイ・バーツ<br>1,297       |
|     | ポーランド  | 百株<br>575.9<br>( )        | 千ポーランド・ズロチ<br>1,159<br>( )      | 百株<br>5.7      | 千ポーランド・ズロチ<br>18       |

（注1）金額は受渡し代金。

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

（注3）金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2016年7月6日から2017年7月5日まで)

|     |       | 買 付                  |                            | 売 付                |                            |
|-----|-------|----------------------|----------------------------|--------------------|----------------------------|
|     |       | □ 数                  | 金 額                        | □ 数                | 金 額                        |
| 外 国 | アメリカ  | 千口<br>147<br>( ー )   | 千アメリカ・ドル<br>2,780<br>( ー ) | 千口<br>129<br>( ー ) | 千アメリカ・ドル<br>2,417<br>( ー ) |
|     | メキシコ  | 千口<br>15.8<br>( ー )  | 千メキシコ・ペソ<br>491<br>( △ 8 ) | 千口<br>ー<br>( ー )   | 千メキシコ・ペソ<br>ー<br>( ー )     |
|     | 南アフリカ | 千口<br>25.74<br>( ー ) | 千南アフリカ・ランド<br>464<br>( ー ) | 千口<br>ー<br>( ー )   | 千南アフリカ・ランド<br>ー<br>( ー )   |

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

(3) 先物取引の種別取引状況

(2016年7月6日から2017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<br>678 | 百万円<br>679 | 百万円<br>ー | 百万円<br>ー |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2016年7月6日から2017年7月5日まで)

| 当 期                                 |           |              |         | 期 付                                 |             |              |          |
|-------------------------------------|-----------|--------------|---------|-------------------------------------|-------------|--------------|----------|
| 買 付                                 |           | 売 付          |         | 買 付                                 |             | 売 付          |          |
| 銘 柄                                 | 株 数       | 金 額          | 平均単価    | 銘 柄                                 | 株 数         | 金 額          | 平均単価     |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)      | 千株<br>654 | 千円<br>58,806 | 円<br>89 | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル) | 千株<br>163.7 | 千円<br>78,467 | 円<br>479 |
| GAZPROM PAO -SPON ADR (ロシア)         | 99.84     | 50,977       | 510     | VALE SA-PREF (ブラジル)                 | 70.8        | 75,575       | 1,067    |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル) | 80        | 42,155       | 526     | PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)    | 135.7       | 68,715       | 506      |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)    | 67.6      | 38,741       | 573     | VALE SA (ブラジル)                      | 45.5        | 51,181       | 1,124    |
| IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)       | 531       | 38,569       | 72      | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル) | 23.9        | 32,300       | 1,351    |
| CHINA MOBILE LTD (香港)               | 30.5      | 38,127       | 1,250   | SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR (ロシア)  | 16.01       | 20,611       | 1,287    |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)   | 50        | 35,450       | 709     | BANCO BRADESCO SA-PREF (ブラジル)       | 17.9        | 20,148       | 1,125    |
| VALE SA-PREF (ブラジル)                 | 30.2      | 30,891       | 1,022   | LUKOIL PJSC-SPON ADR (ロシア)          | 2.55        | 15,627       | 6,128    |
| LUKOIL PJSC-SPON ADR (ロシア)          | 5.2       | 30,873       | 5,937   | BANCO DO BRASIL S. A. (ブラジル)        | 7.2         | 8,243        | 1,144    |
| ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル) | 20.7      | 27,865       | 1,346   | GERDAU SA-PREF (ブラジル)               | 15.7        | 7,089        | 451      |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2016年7月6日から2017年7月5日まで)

| 当 期                                 |           |               |            | 期 付                                 |           |               |            |
|-------------------------------------|-----------|---------------|------------|-------------------------------------|-----------|---------------|------------|
| 買 付                                 |           | 売 付           |            | 買 付                                 |           | 売 付           |            |
| 銘 柄                                 | □ 数       | 金 額           | 平均単価       | 銘 柄                                 | □ 数       | 金 額           | 平均単価       |
| POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT (アメリカ) | 千口<br>147 | 千円<br>315,414 | 円<br>2,145 | POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT (アメリカ) | 千口<br>129 | 千円<br>271,661 | 円<br>2,105 |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)  | 15.8      | 2,929         | 185        |                                     |           |               |            |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)  | 11.44     | 2,527         | 220        |                                     |           |               |            |
| REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)     | 14.3      | 1,356         | 94         |                                     |           |               |            |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国株式

| 銘 柄                          |                          | 期 首               | 当                  | 期 末      |                   | 業 種 等      |
|------------------------------|--------------------------|-------------------|--------------------|----------|-------------------|------------|
|                              |                          | 株 数               | 株 数                | 評 価      | 額                 |            |
|                              |                          | 百株                | 百株                 | 千アメリカ・ドル | 千円                |            |
| (アメリカ)                       |                          |                   |                    |          |                   |            |
| SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF   |                          | 60                | 138                | 66       | 7,576             | その他        |
| MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR    |                          | 88.5              | 117.5              | 99       | 11,214            | 電気通信サービス   |
| VTB BANK JSC -GDR-REG S      |                          | 255.74            | 437.44             | 92       | 10,476            | 金融         |
| TATNEFT PAO-SPONSORED ADR    |                          | 14.9              | 27                 | 104      | 11,846            | エネルギー      |
| SURGUTNEFTEGAS-SP ADR        |                          | 49                | 132.7              | 59       | 6,685             | エネルギー      |
| MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR  |                          | 39.1              | 52.6               | 73       | 8,285             | 素材         |
| SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR |                          | 17.8              | 27.9               | 12       | 1,373             | 電気通信サービス   |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS    |                          | 7.5               | 17.7               | 59       | 6,749             | 生活必需品      |
| MEGAFON-REG S GDR            |                          | 10.8              | 23.2               | 21       | 2,487             | 電気通信サービス   |
| RUSHYDRO PJSC-ADR            |                          | —                 | 116.9              | 15       | 1,738             | 公益事業       |
| SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR |                          | 294.8             | 312                | 329      | 37,221            | 金融         |
| NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S |                          | 2.9               | 4.9                | 55       | 6,305             | エネルギー      |
| LUKOIL PJSC-SPON ADR         |                          | 75.9              | 102.4              | 507      | 57,352            | エネルギー      |
| ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR |                          | 153.3             | 210.9              | 116      | 13,224            | エネルギー      |
| GAZPROM PAO -SPON ADR        |                          | 734               | 1,676.8            | 683      | 77,238            | エネルギー      |
| SEVERSTAL - GDR REG S        |                          | 12.5              | 22                 | 29       | 3,383             | 素材         |
| ROSSETI PJSC                 |                          | —                 | 16,037.2           | 21       | 2,484             | 公益事業       |
| INTER RAO UES PJSC           |                          | —                 | 3,640.2            | 23       | 2,648             | 公益事業       |
| ALROSA PJSC                  |                          | —                 | 149.9              | 22       | 2,557             | 素材         |
| INNER MONGOLIA YITAI COAL-B  |                          | 115               | 177                | 18       | 2,085             | エネルギー      |
| TRANSNEFT PJSC               |                          | —                 | 0.13               | 35       | 3,969             | エネルギー      |
| アメリカ・ドル通貨計                   | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 1,931.74<br>16 銘柄 | 23,424.37<br>21 銘柄 | 2,448    | 276,903<br><8.6%> |            |
| (香港)                         |                          | 百株                | 百株                 | 千香港ドル    | 千円                |            |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H |                          | 140               | 315                | 322      | 4,670             | 資本財・サービス   |
| BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS |                          | 330               | 660                | 407      | 5,906             | 一般消費財・サービス |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H    |                          | 250               | 530                | 329      | 4,765             | 資本財・サービス   |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING |                          | 60                | 120                | 255      | 3,701             | 資本財・サービス   |
| KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS  |                          | —                 | 95                 | 297      | 4,312             | 情報技術       |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT |                          | 200               | 150                | 253      | 3,670             | 一般消費財・サービス |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDIN  |                          | 120               | 220                | 432      | 6,256             | 生活必需品      |
| JIANGXI COPPER CO LTD-H      |                          | 120               | 180                | 224      | 3,247             | 素材         |
| SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD |                          | —                 | 80                 | 182      | 2,646             | 資本財・サービス   |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H |                          | 2,518             | 4,818              | 2,948    | 42,695            | エネルギー      |
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS    |                          | 25                | 60                 | 227      | 3,288             | 資本財・サービス   |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H  |                          | 160               | 360                | 331      | 4,795             | 一般消費財・サービス |
| GOME ELECTRICAL APPLIANCES   |                          | 1,000             | 1,920              | 182      | 2,641             | 一般消費財・サービス |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H |                          | —                 | 380                | 159      | 2,311             | 電気通信サービス   |
| FOSUN INTERNATIONAL LTD      |                          | 75                | 210                | 250      | 3,624             | 資本財・サービス   |
| TENCENT HOLDINGS LTD         |                          | 21                | 44                 | 1,184    | 17,151            | 情報技術       |
| CHINA TELECOM CORP LTD-H     |                          | 1,180             | 2,440              | 897      | 13,001            | 電気通信サービス   |
| SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD   |                          | 160               | 340                | 157      | 2,274             | 一般消費財・サービス |
| CHINA UNICOM HONG KONG LTD   |                          | 480               | 1,100              | 1,238    | 17,934            | 電気通信サービス   |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD |                          | 115               | 155                | 216      | 3,133             | 不動産        |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDIN |                          | 140               | 260                | 381      | 5,526             | 公益事業       |
| PETROCHINA CO LTD-H          |                          | 1,560             | 3,280              | 1,607    | 23,272            | エネルギー      |
| DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD   |                          | 90                | —                  | —        | —                 | 情報技術       |
| CNOOC LTD                    |                          | 1,560             | 2,970              | 2,566    | 37,156            | エネルギー      |
| HUANENG POWER INTL INC-H     |                          | 320               | 740                | 398      | 5,775             | 公益事業       |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H  |                          | 65                | 110                | 301      | 4,372             | 素材         |

| 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    | 千香港ドル   | 千円         |       |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H |       | 190    | 310   | 172     | 2,504      | 公益事業  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 6,180 | 12,410 | 7,433 | 107,638 | 金融         |       |
| CHINA MOBILE LTD             | 255   | 545    | 4,477 | 64,829  | 電気通信サービス   |       |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 64    | 174    | 333   | 4,822   | 金融         |       |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H  | 450   | 1,090  | 524   | 7,591   | 金融         |       |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS     | 100   | —      | —     | —       | 不動産        |       |
| GF SECURITIES CO LTD-H       | —     | 86     | 134   | 1,942   | 金融         |       |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD     | 20    | 40     | 231   | 3,350   | 生活必需品      |       |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | —     | 580    | 266   | 3,863   | 金融         |       |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-H    | 315   | 540    | 918   | 13,292  | エネルギー      |       |
| SINOPHARM GROUP CO-H         | 44    | 100    | 347   | 5,024   | ヘルスケア      |       |
| CHINA RESOURCES LAND LTD     | 100   | 260    | 582   | 8,433   | 不動産        |       |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO   | —     | 110    | 213   | 3,096   | 一般消費財・サービス |       |
| YANZHOU COAL MINING CO-H     | —     | 260    | 175   | 2,545   | エネルギー      |       |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD     | 100   | —      | —     | —       | 資本財・サービス   |       |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 2,080 | 3,760  | 1,394 | 20,199  | 金融         |       |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 26    | 50     | 196   | 2,845   | 金融         |       |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 410   | 1,020  | 336   | 4,873   | 金融         |       |
| CITIC LTD                    | 320   | 410    | 477   | 6,910   | 資本財・サービス   |       |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 450   | 940    | 263   | 3,811   | 金融         |       |
| IND & COMM BK OF CHINA-H     | 5,610 | 10,630 | 5,272 | 76,345  | 金融         |       |
| GUANGDONG INVESTMENT LTD     | 80    | 140    | 146   | 2,120   | 公益事業       |       |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 120   | 320    | 740   | 10,726  | 不動産        |       |
| CRRC CORP LTD - H            | —     | 210    | 146   | 2,122   | 資本財・サービス   |       |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-H | 240   | 480    | 482   | 6,992   | 資本財・サービス   |       |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 155   | 340    | 1,764 | 25,551  | 金融         |       |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD     | 130   | 200    | 320   | 4,645   | 不動産        |       |
| CHINA MINSHENG BANKING-H     | 324   | 774    | 600   | 8,697   | 金融         |       |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO   | 410   | 710    | 651   | 9,427   | 不動産        |       |
| CHINA VANKE CO LTD-H         | —     | 108    | 249   | 3,612   | 不動産        |       |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H   | 140   | 560    | 741   | 10,736  | 金融         |       |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H   | 125   | 205    | 200   | 2,900   | 一般消費財・サービス |       |
| WEICHAI POWER CO LTD-H       | —     | 340    | 227   | 3,298   | 資本財・サービス   |       |
| CHINA POWER INTERNATIONAL    | 190   | 630    | 174   | 2,526   | 公益事業       |       |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | —     | 520    | 215   | 3,117   | 素材         |       |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 90    | 202    | 639   | 9,257   | 金融         |       |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H    | 230   | 420    | 989   | 14,322  | 金融         |       |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD      | 20    | 50     | 235   | 3,406   | 公益事業       |       |
| KUNLUN ENERGY CO LTD         | 200   | 380    | 259   | 3,752   | エネルギー      |       |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H | 96    | 232    | 288   | 4,172   | 不動産        |       |
| CHINA OILFIELD SERVICES-H    | —     | 220    | 140   | 2,035   | エネルギー      |       |
| LENOVO GROUP LTD             | 460   | 1,680  | 831   | 12,041  | 情報技術       |       |
| CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 360   | 780    | 358   | 5,195   | 素材         |       |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H  | 621   | 1,231  | 679   | 9,839   | 金融         |       |
| CHINA EVERGRANDE GROUP       | 310   | 730    | 1,147 | 16,616  | 不動産        |       |
| SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD | 220   | —      | —     | —       | 不動産        |       |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H | 220   | 320    | 170   | 2,465   | 金融         |       |
| DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H | 34    | —      | —     | —       | その他        |       |
| GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD | 780   | 2,040  | 169   | 2,451   | 情報技術       |       |
| CHINA MERCHANTS BANK-H       | 260   | 415    | 966   | 14,001  | 金融         |       |
| BANK OF CHINA LTD-H          | 6,150 | 10,860 | 4,181 | 60,542  | 金融         |       |
| SOHO CHINA LTD               | 195   | —      | —     | —       | 不動産        |       |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H    | 60    | 155    | 247   | 3,586   | 金融         |       |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 210   | 450    | 162   | 2,358   | 金融         |       |

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| 銘柄                           |                     | 期首             | 当              | 期末     |         | 業種等        |
|------------------------------|---------------------|----------------|----------------|--------|---------|------------|
|                              |                     | 株数             | 株数             | 評価額    | 未償額     |            |
|                              |                     | 百株             | 百株             | 千香港ドル  | 千円      |            |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H  |                     | 68             | 180            | 227    | 3,289   | 金融         |
| LONGFOR PROPERTIES           |                     | 75             | 170            | 295    | 4,283   | 不動産        |
| 香港ドル通貨計                      | 株数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 39,976<br>70銘柄 | 80,904<br>76銘柄 | 58,159 | 842,146 |            |
|                              |                     | 百株             | 百株             | 千台湾ドル  | 千円      |            |
| (台湾)                         |                     |                |                |        |         |            |
| HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP |                     | 65             | —              | —      | —       | 不動産        |
| TAIWAN CEMENT                |                     | 120            | 200            | 709    | 2,630   | 素材         |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO |                     | 171.12         | 421.12         | 2,551  | 9,467   | 生活必需品      |
| FORMOSA PLASTICS CORP        |                     | 116            | 286            | 2,659  | 9,867   | 素材         |
| NAN YA PLASTICS CORP         |                     | 111.4          | 351.4          | 2,635  | 9,777   | 素材         |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE    |                     | 83.9           | 283.9          | 2,731  | 10,132  | 素材         |
| CHINA STEEL CORP             |                     | 426.86         | 806.86         | 2,057  | 7,633   | 素材         |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD |                     | 82.55          | 172.55         | 1,125  | 4,173   | 一般消費財・サービス |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP      |                     | 85.74          | 196.16         | 990    | 3,675   | 情報技術       |
| DELTA ELECTRONICS INC        |                     | 80             | 130            | 2,099  | 7,789   | 情報技術       |
| ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR  |                     | 287.5          | 659.29         | 2,544  | 9,441   | 情報技術       |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD    |                     | 60.81          | 91.41          | 836    | 3,103   | 情報技術       |
| INVENTEC CORP                |                     | 300            | 330            | 826    | 3,066   | 情報技術       |
| TATUNG CO LTD                |                     | —              | 470            | 613    | 2,275   | 一般消費財・サービス |
| QUANTA COMPUTER INC          |                     | 130            | 260            | 1,838  | 6,819   | 情報技術       |
| AU OPTRONICS CORP            |                     | 1,350          | 2,370          | 3,116  | 11,562  | 情報技術       |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD      |                     | 174            | 354            | 3,823  | 14,184  | 電気通信サービス   |
| MEDIATEK INC                 |                     | 80.03          | 160.03         | 4,216  | 15,644  | 情報技術       |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD    |                     | 20             | 60             | 2,157  | 8,002   | 情報技術       |
| HTC CORP                     |                     | 152.57         | 222.57         | 1,600  | 5,937   | 情報技術       |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD  |                     | 169.4          | 356.17         | 1,086  | 4,030   | 金融         |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO   |                     | 434.11         | 714.11         | 3,356  | 12,451  | 金融         |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO  |                     | 436.93         | 756.93         | 3,731  | 13,844  | 金融         |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL  |                     | 550.95         | —              | —      | —       | 金融         |
| E. SUN FINANCIAL HOLDING CO  |                     | 217.38         | 531.81         | 997    | 3,699   | 金融         |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO  |                     | 458.28         | 718.28         | 991    | 3,677   | 金融         |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT |                     | 389.93         | 749.93         | 1,912  | 7,094   | 金融         |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING    |                     | 374.89         | 605.76         | 842    | 3,123   | 金融         |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING  |                     | 450.41         | 850.41         | 693    | 2,574   | 金融         |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS   |                     | 364.15         | —              | —      | —       | 金融         |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT |                     | 722.49         | 1,480.28       | 2,975  | 11,038  | 金融         |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO   |                     | 307.2          | 718.22         | 1,461  | 5,422   | 金融         |
| NOVATEK MICROELECTRONICS COR |                     | 20             | 50             | 617    | 2,290   | 情報技術       |
| TAIWAN MOBILE CO LTD         |                     | 60             | 110            | 1,259  | 4,672   | 電気通信サービス   |
| WISTRON CORP                 |                     | 386.58         | 588.14         | 1,785  | 6,622   | 情報技術       |
| INNOLUX CORP                 |                     | 940            | 2,620          | 4,152  | 15,406  | 情報技術       |
| TPK HOLDING CO LTD           |                     | 60             | 80             | 739    | 2,742   | 情報技術       |
| WPG HOLDINGS LTD             |                     | —              | 150            | 605    | 2,245   | 情報技術       |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD  |                     | 60             | 120            | 943    | 3,499   | 電気通信サービス   |
| PEGATRON CORP                |                     | 150            | 340            | 3,287  | 12,197  | 情報技術       |
| RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR |                     | 30             | 80             | 540    | 2,006   | 情報技術       |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC     |                     | 44             | 74             | 691    | 2,566   | 情報技術       |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP   |                     | 60             | 70             | 738    | 2,739   | エネルギー      |
| POU CHEN                     |                     | 154.4          | 144.4          | 624    | 2,317   | 一般消費財・サービス |
| SILICONWARE PRECISION INDS   |                     | 90             | 120            | 593    | 2,201   | 情報技術       |
| COMPAL ELECTRONICS           |                     | 234.53         | 374.53         | 762    | 2,827   | 情報技術       |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC |                     | 600            | 1,100          | 22,770 | 84,476  | 情報技術       |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY   |                     | 610.26         | 1,441.28       | 16,286 | 60,422  | 情報技術       |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP   |                     | 20             | 40             | 1,078  | 3,999   | 生活必需品      |

| 銘 柄                          |               | 期 首        | 当          | 期 末            |             | 業 種 等      |
|------------------------------|---------------|------------|------------|----------------|-------------|------------|
|                              |               | 株 数        | 株 数        | 評 価            | 額           |            |
|                              |               | 株 数        | 株 数        | 外貨建金額          | 邦貨換算金額      |            |
| ASUSTEK COMPUTER INC         |               | 百株<br>27.6 | 百株<br>47.6 | 千台湾ドル<br>1,356 | 千円<br>5,032 | 情報技術       |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP |               | 132.6      | —          | —              | —           | 資本財・サービス   |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP |               | 700        | 1,150      | 1,633          | 6,058       | 情報技術       |
| 台 湾 ド ル 通 貨 計                | 株 数、金 額       | 13,153.57  | 24,007.14  | 117,646        | 436,469     |            |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 50 銘柄      | 48 銘柄      |                | <13.5%>     |            |
| (トルコ)                        |               | 百株         | 百株         | 千トルコ・リラ        | 千円          |            |
| TURKIYE GARANTI BANKASI      |               | 135.8      | 291.4      | 292            | 9,300       | 金融         |
| AKBANK T. A. S.              |               | 122.3      | 270.9      | 270            | 8,603       | 金融         |
| TURKIYE IS BANKASI-C         |               | 144        | 271.7      | 202            | 6,452       | 金融         |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS  |               | 52.4       | 98.5       | 114            | 3,644       | 電気通信サービス   |
| TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE |               | 10.3       | 25.2       | 252            | 8,019       | エネルギー      |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK |               | 126.31     | 178.31     | 125            | 3,984       | 素材         |
| HACI OMER SABANCI HOLDING    |               | 72.2       | 146.2      | 159            | 5,084       | 金融         |
| TURKIYE HALK BANKASI         |               | 60.9       | 153.6      | 203            | 6,469       | 金融         |
| YAPI VE KREDI BANKASI        |               | 69.8       | 173.7      | 79             | 2,540       | 金融         |
| TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D |               | 101.9      | 193.2      | 127            | 4,065       | 金融         |
| KOC HOLDING AS               |               | 49.75      | 112.55     | 183            | 5,832       | 資本財・サービス   |
| TURK HAVA YOLLARI AO         |               | 32         | 157.6      | 131            | 4,183       | 資本財・サービス   |
| TURK TELEKOMUNIKASYON AS     |               | 46.3       | 110        | 68             | 2,168       | 電気通信サービス   |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS    |               | 5.9        | 15.5       | 99             | 3,173       | 生活必需品      |
| トルコ・リラ通貨計                    | 株 数、金 額       | 1,029.86   | 2,198.36   | 2,312          | 73,522      |            |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 14 銘柄      | 14 銘柄      |                | <2.3%>      |            |
| (メキシコ)                       |               | 百株         | 百株         | 千メキシコ・ペソ       | 千円          |            |
| AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L |               | 1,854      | 4,864      | 7,120          | 44,291      | 電気通信サービス   |
| GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO   |               | 59         | 151        | 1,356          | 8,436       | 一般消費財・サービス |
| CEMEX SAB-CPO                |               | 1,380.14   | 1,798.19   | 3,159          | 19,651      | 素材         |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD |               | 46         | 155        | 2,715          | 16,891      | 生活必需品      |
| GRUPO FIN SANTANDER-B        |               | 106        | 225        | 805            | 5,013       | 金融         |
| COCA-COLA FEMSA SAB-SER L    |               | 16         | 42         | 649            | 4,038       | 生活必需品      |
| MEXICHEM SAB DE CV-*         |               | 49         | 110.23     | 528            | 3,286       | 素材         |
| GRUPO BIMBO SAB- SERIES A    |               | 35         | 103        | 462            | 2,876       | 生活必需品      |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV |               | —          | 7.9        | 326            | 2,032       | 素材         |
| ALFA S. A. B. -A             |               | 118        | 424        | 1,097          | 6,825       | 資本財・サービス   |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B |               | 179        | 302        | 1,594          | 9,920       | 素材         |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA-O   |               | 68         | 157        | 486            | 3,026       | 金融         |
| WALMART DE MEXICO SAB DE CV  |               | 163        | 398        | 1,667          | 10,370      | 生活必需品      |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE-O   |               | 61         | 179        | 2,074          | 12,902      | 金融         |
| メキシコ・ペソ通貨計                   | 株 数、金 額       | 4,134.14   | 8,916.32   | 24,045         | 149,563     |            |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 13 銘柄      | 14 銘柄      |                | <4.6%>      |            |
| (チリ)                         |               | 百株         | 百株         | 千チリ・ペソ         | 千円          |            |
| ENEL CHILE SA                |               | 1,523.1    | 1,523.1    | 11,328         | 1,930       | 公益事業       |
| ENEL GENERACION CHILE SA     |               | 179.8      | 266.8      | 13,572         | 2,312       | 公益事業       |
| ENDESA AMERICAS SA           |               | 179.8      | —          | —              | —           | その他        |
| LATAM AIRLINES GROUP SA      |               | 14.8       | 28.8       | 21,727         | 3,702       | 資本財・サービス   |
| CENCOSUD SA                  |               | 37.3       | 93.4       | 16,558         | 2,821       | 生活必需品      |
| BANCO SANTANDER CHILE        |               | 3,898.5    | 5,410.5    | 23,822         | 4,059       | 金融         |
| ENEL AMERICAS SA             |               | 1,523.1    | 2,489.2    | 32,548         | 5,546       | 公益事業       |
| SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B |               | —          | 5          | 11,548         | 1,967       | 素材         |
| S. A. C. I. FALABELLA        |               | 19.1       | 19.1       | 10,615         | 1,808       | 一般消費財・サービス |
| BANCO DE CHILE               |               | 1,436.33   | 1,945.94   | 17,324         | 2,952       | 金融         |
| チリ・ペソ通貨計                     | 株 数、金 額       | 8,811.83   | 11,781.84  | 159,047        | 27,101      |            |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 9 銘柄       | 9 銘柄       |                | <0.8%>      |            |

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| 銘 柄                          | 株 数                      | 株 数               | 期 末 評 価 額         |                              | 業 種 等      |
|------------------------------|--------------------------|-------------------|-------------------|------------------------------|------------|
|                              |                          |                   | 外貨建金額             | 邦貨換算金額                       |            |
| (インド)                        | 百株                       | 百株                | 千インド・ルピー          | 千円                           |            |
| TATA STEEL LTD               | 44                       | 37.4              | 2,047             | 3,604                        | 素材         |
| AXIS BANK LTD                | 25.6                     | 82.4              | 4,189             | 7,373                        | 金融         |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD      | —                        | 2                 | 1,475             | 2,596                        | 一般消費財・サービス |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD       | 8                        | 17.6              | 1,915             | 3,370                        | 生活必需品      |
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP     | 17.3                     | 63.4              | 3,245             | 5,711                        | エネルギー      |
| STATE BANK OF INDIA          | 145.2                    | 194.5             | 5,309             | 9,345                        | 金融         |
| NTPC LTD                     | 128.8                    | 197.6             | 3,123             | 5,496                        | 公益事業       |
| JSW STEEL LTD                | 10                       | 100               | 2,083             | 3,666                        | 素材         |
| INDIAN OIL CORP LTD          | 31.4                     | 132.7             | 5,067             | 8,918                        | エネルギー      |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD    | 17.2                     | 75.7              | 4,975             | 8,756                        | エネルギー      |
| CAIRN INDIA LTD              | 47.9                     | —                 | —                 | —                            | その他        |
| IDEA CELLULAR LTD            | 58.4                     | 117.6             | 987               | 1,737                        | 電気通信サービス   |
| PUNJAB NATIONAL BANK         | 59                       | —                 | —                 | —                            | 金融         |
| RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD  | 13.7                     | —                 | —                 | —                            | 公益事業       |
| JINDAL STEEL & POWER LTD     | 99.5                     | —                 | —                 | —                            | 素材         |
| TATA MOTORS LTD-A-DVR        | 27.4                     | 44.4              | 1,167             | 2,055                        | 一般消費財・サービス |
| RURAL ELECTRIFICATION CORP   | 42.1                     | 84.2              | 1,454             | 2,559                        | 金融         |
| COAL INDIA LTD               | 59.8                     | 139.1             | 3,432             | 6,040                        | エネルギー      |
| INDIABULLS HOUSING FINANCE L | 11.1                     | 17.3              | 1,818             | 3,200                        | 金融         |
| GAIL INDIA LTD               | 19.2                     | 29.5              | 1,077             | 1,896                        | 公益事業       |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD      | 176.5                    | 146.5             | 2,906             | 5,115                        | 素材         |
| WIPRO LTD                    | 9.7                      | 60.4              | 1,570             | 2,763                        | 情報技術       |
| TATA CONSULTANCY SVCS LTD    | 7                        | 15.88             | 3,758             | 6,615                        | 情報技術       |
| INFOSYS LTD                  | 38.8                     | 87.8              | 8,447             | 14,867                       | 情報技術       |
| LARSEN & TOUBRO LTD          | 7.55                     | 11.55             | 1,944             | 3,421                        | 資本財・サービス   |
| TATA MOTORS LTD              | 70.1                     | 114.3             | 4,879             | 8,587                        | 一般消費財・サービス |
| BHARAT HEAVY ELECTRICALS     | 70.1                     | —                 | —                 | —                            | 資本財・サービス   |
| RELIANCE COMMUNICATIONS LTD  | 124.8                    | 283.8             | 594               | 1,046                        | 電気通信サービス   |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE  | 31.3                     | 55.1              | 9,039             | 15,910                       | 金融         |
| HDFC BANK LIMITED            | 11.3                     | —                 | —                 | —                            | 金融         |
| ICICI BANK LTD               | 142.2                    | 173.14            | 5,012             | 8,821                        | 金融         |
| RELIAANCE INDUSTRIES LTD     | 80.6                     | 153.7             | 21,855            | 38,465                       | エネルギー      |
| OIL & NATURAL GAS CORP LTD   | 93.5                     | 385.75            | 6,168             | 10,855                       | エネルギー      |
| ITC LTD                      | 57.6                     | 95.4              | 3,217             | 5,662                        | 生活必需品      |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD      | 11.7                     | 19.3              | 2,615             | 4,603                        | 一般消費財・サービス |
| HERO MOTOCORP LTD            | 2.7                      | 4.7               | 1,740             | 3,063                        | 一般消費財・サービス |
| BHARTI AIRTEL LTD            | 56.9                     | 100.2             | 3,800             | 6,689                        | 電気通信サービス   |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS     | 7.6                      | 20.5              | 1,132             | 1,993                        | ヘルスケア      |
| HCL TECHNOLOGIES LTD         | —                        | 18.2              | 1,531             | 2,695                        | 情報技術       |
| VEDANTA LTD                  | 156.8                    | 80.5              | 2,054             | 3,616                        | 素材         |
| インド・ルピー通貨計                   | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 2,022.35<br>38 銘柄 | 3,162.12<br>34 銘柄 | 125,639<br>221,125<br><6.9%> |            |
| (インドネシア)                     | 百株                       | 百株                | 千インドネシア・ルピア       | 千円                           |            |
| UNITED TRACTORS TBK PT       | 98                       | 125               | 356,250           | 3,028                        | エネルギー      |
| ASTRA INTERNATIONAL TBK PT   | 904                      | 1,312             | 1,151,280         | 9,785                        | 一般消費財・サービス |
| SEMEN INDONESIA PERSERO TBK  | 111                      | —                 | —                 | —                            | 素材         |
| INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P | —                        | 313               | 273,875           | 2,327                        | 生活必需品      |
| TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER | 1,801                    | 3,218             | 1,477,062         | 12,555                       | 電気通信サービス   |
| BANK NEGARA INDONESIA PERSER | 332                      | 520               | 341,900           | 2,906                        | 金融         |
| BANK CENTRAL ASIA TBK PT     | 214                      | 438               | 812,490           | 6,906                        | 金融         |
| BANK MANDIRI PERSERO TBK PT  | 338                      | 664               | 896,400           | 7,619                        | 金融         |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER | 538                      | 1,334             | 310,822           | 2,641                        | 公益事業       |



| 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     | 千円     |           |        |            |
| BANK RAKYAT INDONESIA PERSER  |   | 316    | 779    | 1,191,870 | 10,130 | 金融         |
| ADARO ENERGY TBK PT           |   | —      | 1,327  | 209,666   | 1,782  | エネルギー      |
| インドネシア・ルピア通貨計                 |   | 4,652  | 10,030 | 7,021,615 | 59,683 |            |
| 銘柄数 < 比率 >                    |   | 9 銘柄   | 10 銘柄  | < 1.8% >  |        |            |
| (ブラジル)                        |   | 百株     | 百株     | 千ブラジル・リアル | 千円     |            |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR  |   | 1,663  | 826    | 1,026     | 35,072 | エネルギー      |
| VALE SA-PREF                  |   | 706    | 300    | 821       | 28,048 | 素材         |
| BANCO BRADESCO SA-PREF        |   | 315.37 | 337.4  | 952       | 32,525 | 金融         |
| ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF  |   | 352.13 | 356.24 | 1,315     | 44,940 | 金融         |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA   |   | 101    | 100    | 72        | 2,462  | 素材         |
| VALE SA                       |   | 460    | 197    | 583       | 19,932 | 素材         |
| GERDAU SA-PREF                |   | 218    | 172    | 178       | 6,087  | 素材         |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS     |   | 1,397  | 716    | 953       | 32,578 | エネルギー      |
| CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF  |   | 165.97 | 239.97 | 195       | 6,680  | 公益事業       |
| ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR  |   | 224.29 | 192.29 | 173       | 5,918  | 金融         |
| BRASKEM SA-PREF A             |   | 18     | 18     | 61        | 2,112  | 素材         |
| CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B  |   | 32     | 27     | 43        | 1,498  | 公益事業       |
| BANCO DO BRASIL S. A.         |   | 182    | 214    | 584       | 19,964 | 金融         |
| COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO   |   | 12     | —      | —         | —      | エネルギー      |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER  |   | —      | 34     | 43        | 1,469  | 公益事業       |
| CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB  |   | 21     | 24     | 59        | 2,022  | 公益事業       |
| EMBRAER SA                    |   | 33     | 84     | 128       | 4,378  | 資本財・サービス   |
| METALURGICA GERDAU SA-PREF    |   | —      | 417    | 211       | 7,207  | 素材         |
| CCR SA                        |   | 49     | 62     | 104       | 3,579  | 資本財・サービス   |
| BRF SA                        |   | 37     | 67     | 262       | 8,962  | 生活必需品      |
| NATURA COSMETICOS SA          |   | 15     | 25     | 62        | 2,141  | 生活必需品      |
| CIA SANEAMENTO BASICO DE SP   |   | 36     | 37     | 117       | 4,025  | 公益事業       |
| CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP   |   | 29     | —      | —         | —      | 一般消費財・サービス |
| CIA ENERGETICA DE SP-PREF B   |   | —      | 37     | 56        | 1,946  | 公益事業       |
| TIM PARTICIPACOES SA          |   | 97.26  | 104.26 | 102       | 3,515  | 電気通信サービス   |
| TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF |   | 33     | 51     | 231       | 7,900  | 電気通信サービス   |
| CPFL ENERGIA SA               |   | 37.87  | 35.87  | 94        | 3,242  | 公益事業       |
| LOJAS RENNER S. A.            |   | 24     | 32.5   | 88        | 3,039  | 一般消費財・サービス |
| LOJAS AMERICANAS SA-PREF      |   | 19.2   | —      | —         | —      | 一般消費財・サービス |
| JBS SA                        |   | 74     | 170    | 112       | 3,838  | 生活必需品      |
| ENGIE BRASIL ENERGIA SA       |   | 16     | 24     | 82        | 2,807  | 公益事業       |
| MARFRIG GLOBAL FOODS SA       |   | —      | 90     | 61        | 2,112  | 生活必需品      |
| EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA   |   | 32     | —      | —         | —      | 公益事業       |
| BM&FBOVESPA SA                |   | 110    | 84     | 166       | 5,692  | 金融         |
| AES TIETE ENERGIA SA-UNIT     |   | 23     | —      | —         | —      | 公益事業       |
| PORTO SEGURO SA               |   | 12     | —      | —         | —      | 金融         |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA     |   | 44.2   | 45.08  | 54        | 1,852  | 不動産        |
| CIELO SA                      |   | 24.07  | 63.28  | 154       | 5,265  | 情報技術       |
| FIBRIA CELULOSE SA            |   | 13     | 27     | 89        | 3,048  | 素材         |
| CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF    |   | 27     | 36     | 229       | 7,824  | 生活必需品      |
| EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD   |   | 10     | 10     | 54        | 1,868  | 公益事業       |
| SUL AMERICA SA - UNITS        |   | 23     | —      | —         | —      | 金融         |
| BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT   |   | 46     | 45     | 114       | 3,910  | 金融         |
| KLABIN SA - UNIT              |   | 16     | —      | —         | —      | 素材         |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA     |   | 25     | 43     | 332       | 11,367 | エネルギー      |
| KROTON EDUCACIONAL SA         |   | 48     | 68     | 102       | 3,484  | 一般消費財・サービス |
| BANCO BRADESCO S. A.          |   | 74.43  | 80.17  | 221       | 7,574  | 金融         |
| AMBEV SA                      |   | 183    | 296    | 539       | 18,443 | 生活必需品      |

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| 銘柄                                                    | 株数                  | 当株数               | 期末評価額                |                              | 業種等        |
|-------------------------------------------------------|---------------------|-------------------|----------------------|------------------------------|------------|
|                                                       |                     |                   | 外貨建金額                | 邦貨換算金額                       |            |
| GRUPO BTG PACTUAL-UNIT<br>BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 百株<br>—<br>13       | 百株<br>30<br>—     | 千ブラジル・レアル<br>46<br>— | 千円<br>1,578<br>—             | 金融<br>金融   |
| ブラジル・レアル通貨計                                           | 株数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 7,091.79<br>45 銘柄 | 5,818.06<br>41 銘柄    | 10,887<br>371,925<br><11.5%> |            |
| (マレーシア)                                               |                     | 百株                | 百株                   | 千マレーシア・リンギット                 | 千円         |
| MISC BHD                                              | 67                  | —                 | —                    | —                            | 資本財・サービス   |
| MALAYAN BANKING BHD                                   | 190                 | 374               | 360                  | 9,495                        | 金融         |
| GENTING BHD                                           | 77                  | 108               | 100                  | 2,653                        | 一般消費財・サービス |
| PUBLIC BANK BERHAD                                    | 114                 | 226               | 458                  | 12,070                       | 金融         |
| SIME DARBY BERHAD                                     | 94                  | 397               | 377                  | 9,933                        | 資本財・サービス   |
| AXIATA GROUP BERHAD                                   | 180                 | 183               | 87                   | 2,296                        | 電気通信サービス   |
| KUALA LUMPUR KEPONG BHD                               | 17                  | 37                | 92                   | 2,421                        | 生活必需品      |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD                          | 103                 | 234               | 167                  | 4,395                        | 素材         |
| GENTING MALAYSIA BHD                                  | —                   | 173               | 97                   | 2,558                        | 一般消費財・サービス |
| IJM CORP BHD                                          | 112                 | —                 | —                    | —                            | 資本財・サービス   |
| IOI CORP BHD                                          | 110                 | 169               | 75                   | 1,983                        | 生活必需品      |
| CIMB GROUP HOLDINGS BHD                               | 233                 | 672               | 437                  | 11,509                       | 金融         |
| TENAGA NASIONAL BHD                                   | 169                 | 364               | 513                  | 13,503                       | 公益事業       |
| PETRONAS GAS BHD                                      | 19                  | 44                | 81                   | 2,141                        | 公益事業       |
| DIGI.COM BHD                                          | 124                 | 269               | 134                  | 3,538                        | 電気通信サービス   |
| MAXIS BHD                                             | 85                  | —                 | —                    | —                            | 電気通信サービス   |
| SAPURA ENERGY BHD                                     | 187                 | 482               | 78                   | 2,054                        | エネルギー      |
| マレーシア・リンギット通貨計                                        | 株数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 1,881<br>16 銘柄    | 3,732<br>14 銘柄       | 3,061<br>80,556<br><2.5%>    |            |
| (南アフリカ)                                               |                     | 百株                | 百株                   | 千南アフリカ・ランド                   | 千円         |
| GOLD FIELDS LTD                                       | 89                  | 173.6             | 795                  | 6,807                        | 素材         |
| STEINHOFF INTERNATIONAL H NV                          | 48.8                | 147.9             | 1,012                | 8,669                        | 一般消費財・サービス |
| VODACOM GROUP LTD                                     | 18.2                | 55                | 911                  | 7,804                        | 電気通信サービス   |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD                                 | 23.3                | 36                | 713                  | 6,109                        | 生活必需品      |
| NEDBANK GROUP LTD                                     | 16.1                | 26.7              | 563                  | 4,821                        | 金融         |
| BIDVEST GROUP LTD                                     | 18.4                | 21.8              | 349                  | 2,995                        | 資本財・サービス   |
| BID CORP LTD                                          | 18.4                | 28.1              | 851                  | 7,288                        | 生活必需品      |
| NETCARE LTD                                           | 59.3                | 104.6             | 266                  | 2,278                        | ヘルスケア      |
| STANDARD BANK GROUP LTD                               | 99.1                | 162.2             | 2,368                | 20,278                       | 金融         |
| IMPERIAL HOLDINGS LTD                                 | 23.8                | 29.4              | 484                  | 4,151                        | 一般消費財・サービス |
| SASOL LTD                                             | 43                  | 100.7             | 3,771                | 32,281                       | 素材         |
| REMGRO LTD                                            | 12.3                | 27.6              | 595                  | 5,096                        | 金融         |
| EXXARO RESOURCES LTD                                  | —                   | 23.9              | 229                  | 1,966                        | エネルギー      |
| KUMBA IRON ORE LTD                                    | —                   | 16.5              | 288                  | 2,468                        | 素材         |
| PICK N PAY STORES LTD                                 | —                   | 37.7              | 222                  | 1,904                        | 生活必需品      |
| TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD                           | 18                  | 37.2              | 265                  | 2,276                        | 一般消費財・サービス |
| SANLAM LTD                                            | 102.2               | 157               | 1,040                | 8,903                        | 金融         |
| TIGER BRANDS LTD                                      | 7.6                 | 9.3               | 349                  | 2,993                        | 生活必需品      |
| FIRSTRAND LTD                                         | 145.3               | 260.9             | 1,261                | 10,798                       | 金融         |
| AFRICAN PHOENIX INV LTD                               | 147.34              | —                 | —                    | —                            | 金融         |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD                               | 29.7                | 70.2              | 441                  | 3,776                        | 一般消費財・サービス |
| THE FOSCHINI GROUP LTD                                | 11.7                | 16.8              | 235                  | 2,017                        | 一般消費財・サービス |
| BARCLAYS AFRICA GROUP LTD                             | 27.3                | 69.9              | 1,009                | 8,641                        | 金融         |
| NASPERS LTD-N SHS                                     | 2.6                 | 9.6               | 2,388                | 20,445                       | 一般消費財・サービス |
| INVESTEC LTD                                          | 14                  | 31                | 306                  | 2,624                        | 金融         |
| MTN GROUP LTD                                         | 167                 | 333.1             | 3,848                | 32,941                       | 電気通信サービス   |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD                          | 75.8                | 120               | 442                  | 3,785                        | 素材         |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT                          | 4.9                 | 12.2              | 354                  | 3,033                        | ヘルスケア      |
| HARMONY GOLD MINING CO LTD                            | 33.1                | —                 | —                    | —                            | 素材         |

| 銘                            | 柄 | 期 首     | 当         | 期 末        |           | 業 種 等      |
|------------------------------|---|---------|-----------|------------|-----------|------------|
|                              |   | 株 数     | 株 数       | 評 価        | 額         |            |
|                              |   | 株 数     | 株 数       | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |            |
|                              |   | 百株      | 百株        | 千南アフリカ・ランド | 千円        |            |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD        |   | 29      | 44        | 563        | 4,826     | 素材         |
| BARLOWORLD LTD               |   | 27.7    | 39.1      | 435        | 3,729     | 資本財・サービス   |
| SAPPI LIMITED                |   | 47.1    | 68.2      | 606        | 5,189     | 素材         |
| TELKOM SA SOC LTD            |   | 26.8    | 40.9      | 258        | 2,212     | 電気通信サービス   |
| MONDI LTD                    |   | —       | 8.4       | 288        | 2,470     | 素材         |
| MMI HOLDINGS LTD             |   | 70.5    | 130.1     | 264        | 2,260     | 金融         |
| NAMPAC LTD                   |   | 76      | —         | —          | —         | 素材         |
| SPAR GROUP LIMITED/THE       |   | 10.9    | 19.4      | 301        | 2,584     | 生活必需品      |
| MR PRICE GROUP LTD           |   | 8.3     | 15.9      | 248        | 2,130     | 一般消費財・サービス |
| LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN |   | 39.6    | 96        | 242        | 2,072     | ヘルスケア      |
| SIBANYE GOLD LTD             |   | 32.5    | 147       | 222        | 1,906     | 素材         |
| BRAIT SE                     |   | —       | 36.4      | 225        | 1,928     | 金融         |
| 南アフリカ・ランド通貨計                 |   | 株 数、金 額 | 2,764.3   | 29,026     | 248,469   |            |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                |   | 36 銘柄   | 38 銘柄     |            | <7.7%>    |            |
| (タイ)                         |   | 百株      | 百株        | 千タイ・パーツ    | 千円        |            |
| BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG |   | 26      | 58        | 1,125      | 3,735     | 金融         |
| SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG   |   | 11      | —         | —          | —         | 素材         |
| SIAM CEMENT PCL-NVDR         |   | —       | 21        | 1,062      | 3,527     | 素材         |
| KASIKORNBANK PCL-FOREIGN     |   | 45      | 49        | 989        | 3,286     | 金融         |
| KASIKORNBANK PCL-NVDR        |   | —       | 32        | 636        | 2,114     | 金融         |
| SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR  |   | 68      | 229       | 3,549      | 11,784    | 金融         |
| THANACHART CAPITAL PCL-NVDR  |   | —       | 140       | 651        | 2,161     | 金融         |
| ADVANCED INFO SERVICE-NVDR   |   | 57      | 128       | 2,278      | 7,564     | 電気通信サービス   |
| KRUNG THAI BANK - NVDR       |   | 183     | 773       | 1,445      | 4,799     | 金融         |
| BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR     |   | —       | 615       | 1,008      | 3,348     | エネルギー      |
| PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR   |   | 137     | 226       | 1,966      | 6,527     | エネルギー      |
| IRPC PCL - NVDR              |   | 773     | 1,788     | 956        | 3,175     | エネルギー      |
| BANGCHAK CORP PCL-NVDR       |   | —       | 231       | 773        | 2,569     | エネルギー      |
| PTT PCL-NVDR                 |   | 103     | 246       | 9,200      | 30,545    | エネルギー      |
| THAI OIL PCL-NVDR            |   | 68      | 161       | 1,211      | 4,022     | エネルギー      |
| CP ALL PCL-NVDR              |   | 86      | 228       | 1,442      | 4,787     | 生活必需品      |
| TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR  |   | 112     | 189       | 978        | 3,247     | 電気通信サービス   |
| CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR  |   | 256     | 516       | 1,284      | 4,265     | 生活必需品      |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR |   | 137     | 295       | 2,035      | 6,757     | 素材         |
| タイ・パーツ通貨計                    |   | 株 数、金 額 | 5,925     | 32,596     | 108,220   |            |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                |   | 14 銘柄   | 18 銘柄     |            | <3.4%>    |            |
| (ポーランド)                      |   | 百株      | 百株        | 千ポーランド・ズロチ | 千円        |            |
| PKO BANK POLSKI SA           |   | 56.6    | 90.7      | 312        | 9,484     | 金融         |
| BANK PEKAO SA                |   | 7.2     | 20        | 247        | 7,510     | 金融         |
| POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE |   | 40.1    | 91.4      | 403        | 12,231    | 金融         |
| POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I  |   | 101     | 162       | 104        | 3,176     | エネルギー      |
| PGE SA                       |   | 65      | 140.9     | 168        | 5,116     | 公益事業       |
| POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN |   | 25.3    | 48.7      | 537        | 16,288    | エネルギー      |
| TAURON POLSKA ENERGIA SA     |   | —       | 224.8     | 77         | 2,357     | 公益事業       |
| ENERGA SA                    |   | —       | 74.3      | 76         | 2,308     | 公益事業       |
| KGHM POLSKA MIEDZ SA         |   | 17.2    | 29.8      | 333        | 10,098    | 素材         |
| ポーランド・ズロチ通貨計                 |   | 株 数、金 額 | 882.6     | 2,262      | 68,572    |            |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                |   | 7 銘柄    | 9 銘柄      |            | <2.1%>    |            |
| ファンダ合計                       |   | 株 数、金 額 | 88,683.32 | 183,546.11 | 2,964,260 |            |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                |   | 337 銘柄  | 346 銘柄    | —          | <91.8%>   |            |

(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) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国投資信託証券

| 銘柄                           |               | 期 首   | 当 期    | 期 末               |
|------------------------------|---------------|-------|--------|-------------------|
|                              |               | □ 数   | □ 数    | 評 価 額             |
|                              |               | 千□    | 千□     | 外貨建金額<br>千アメリカ・ドル |
| (アメリカ)                       |               |       |        | 千円                |
| POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT |               | 57    | 75     | 1,499             |
| ア メ リ カ ・ ド ル 通 貨 計          | □ 数、金 額       | 57    | 75     | 1,499             |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 銘柄  | 1 銘柄   | <5.3%>            |
| (メキシコ)                       |               | 千□    | 千□     | 千メキシコ・ペソ          |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA  |               | 6.7   | 22.5   | 770               |
| メ キ シ コ ・ ペ ソ 通 貨 計          | □ 数、金 額       | 6.7   | 22.5   | 770               |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 銘柄  | 1 銘柄   | <0.1%>            |
| (南アフリカ)                      |               | 千□    | 千□     | 千南アフリカ・ランド        |
| REDEFINE PROPERTIES LTD      |               | 16.42 | 30.72  | 322               |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD   |               | 11.05 | 22.49  | 552               |
| 南アフリカ・ランド通貨計                 | □ 数、金 額       | 27.47 | 53.21  | 874               |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 2 銘柄  | 2 銘柄   | <0.2%>            |
| 合 計                          | □ 数、金 額       | 91.17 | 150.71 | —                 |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4 銘柄  | 4 銘柄   | <5.6%>            |

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

■投資信託財産の構成

2017年7月5日現在

| 項 目          | 当 期 末     |        |
|--------------|-----------|--------|
|              | 評 価 額     | 比 率    |
|              |           | 千円     |
| 株式           | 2,964,260 | 91.5 % |
| 投資信託証券       | 181,819   | 5.6    |
| コール・ローン等、その他 | 93,382    | 2.9    |
| 投資信託財産総額     | 3,239,461 | 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＝113.08円、1香港ドル＝14.48円、1台湾ドル＝3.71円、1トルコ・リラ＝31.79円、1メキシコ・ペソ＝6.22円、100チリ・ペソ＝17.04円、1インド・ルピー＝1.76円、100インドネシア・ルピア＝0.85円、1ブラジル・レアル＝34.16円、1マレーシア・リングgit＝26.31円、1南アフリカ・ランド＝8.56円、1タイ・バーツ＝3.32円、1ポーランド・ズロチ＝30.31円です。  
(注3) 当期末における外貨建純資産 (3,189,620千円) の投資信託財産総額 (3,239,461千円) に対する比率は、98.5% です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年7月5日現在

| 項 目            | 当 期 末          |
|----------------|----------------|
| (A)資産          | 3,239,461,837円 |
| コール・ローン等       | 65,561,810     |
| 株式（評価額）        | 2,964,260,524  |
| 投資信託証券（評価額）    | 181,819,144    |
| 未収入金           | 27,078         |
| 未収配当金          | 25,219,770     |
| 差入委託証拠金        | 2,573,511      |
| (B)負債          | 11,592,654     |
| 未払金            | 9,043,594      |
| 未払解約金          | 2,520,000      |
| その他未払費用        | 29,060         |
| (C)純資産総額（A－B）  | 3,227,869,183  |
| 元本             | 2,236,184,868  |
| 次期繰越損益金        | 991,684,315    |
| (D)受益権総口数      | 2,236,184,868口 |
| 1万口当り基準価額（C／D） | 14,435円        |

\*期首における元本額は1,427,887,306円、当期中における追加設定元本額は1,873,531,273円、同解約元本額は1,065,233,711円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、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（適格機関投資家専用）2,887,497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）118,938,675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）61,903,749円、D－I's 新興国株式インデックス48,973,624円、iFree 新興国株式インデックス613,728,793円、iFree 8資産バランス311,179,230円、D C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751,707,390円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式291,517,945円、ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド35,347,965円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は14,435円です。

■損益の状況

当期 自2016年7月6日 至2017年7月5日

| 項 目               | 当 期           |
|-------------------|---------------|
| (A)配当等収益          | 71,291,912円   |
| 受取配当金             | 71,185,487    |
| 受取利息              | 123,497       |
| その他収益金            | 6,844         |
| 支払利息              | △ 23,916      |
| (B)有価証券売買損益       | 499,812,288   |
| 売買益               | 590,777,752   |
| 売買損               | △ 90,965,464  |
| (C)先物取引等損益        | 1,020,984     |
| 取引益               | 3,661,489     |
| 取引損               | △ 2,640,505   |
| (D)その他費用          | △ 12,927,024  |
| (E)当期損益金（A＋B＋C＋D） | 559,198,160   |
| (F)前期繰越損益金        | 85,703,517    |
| (G)解約差損益金         | △ 318,043,289 |
| (H)追加信託差損益金       | 664,825,927   |
| (I)合計（E＋F＋G＋H）    | 991,684,315   |
| 次期繰越損益金（I）        | 991,684,315   |

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

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

# ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

## 運用報告書（全体版） 第 1 期

（決算日 2017年11月30日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

### 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。

さて、「ダイワファンドラップオンライン日本債券インデックス」は、このたび、第1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

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）

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

設定以来の運用実績

| 決 算 期             | 基 準 価 額     |           |           | ダイワ・ボンド・インデックス<br>( D B I ) 総 合 指 数 |           | 公 社 債<br>組 入 比 率 | 債 券 先 物 率<br>比 | 純 資 産<br>総 額 |
|-------------------|-------------|-----------|-----------|-------------------------------------|-----------|------------------|----------------|--------------|
|                   |             | 税 込 分 配 金 | 期 中 騰 落 率 | (ベンチマーク)                            | 期 中 騰 落 率 |                  |                |              |
| 1 期末(2017年11月30日) | 円<br>10,010 | 円<br>0    | %<br>0.1  | 522.295                             | %<br>0.2  | %<br>99.3        | %<br>－         | 百万円<br>1,379 |

(注 1) ダイワ・ボンド・インデックス (D B I) 総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。

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

(注 3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注 4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。





## 運用経過

### 基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、設定時を10,000として指数化したものです。

\*ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数です。

#### ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：10,010円

騰落率：0.1%

#### ■基準価額の主な変動要因

債券からの利息収入により、基準価額は小幅に上昇しました。

| 年 月 日             | 基 準 価 額     |        | ダイワ・ボンド・インデックス<br>( D B I ) 総 合 指 数 |        | 公 社 債 率<br>組 入 比 | 債 券 先 物 率<br>比 |
|-------------------|-------------|--------|-------------------------------------|--------|------------------|----------------|
|                   |             | 騰 落 率  | (ベンチマーク)                            | 騰 落 率  |                  |                |
| (設定) 2017年 1 月11日 | 円<br>10,000 | %<br>－ | (1/10)<br>521.157                   | %<br>－ | %<br>－           | %<br>－         |
| 1 月末              | 9,957       | △0.4   | 518.958                             | △0.4   | 99.2             | －              |
| 2 月末              | 9,987       | △0.1   | 520.564                             | △0.1   | 99.1             | －              |
| 3 月末              | 9,972       | △0.3   | 519.891                             | △0.2   | 98.0             | －              |
| 4 月末              | 10,020      | 0.2    | 522.469                             | 0.3    | 99.5             | －              |
| 5 月末              | 10,000      | 0.0    | 521.440                             | 0.1    | 98.9             | －              |
| 6 月末              | 9,972       | △0.3   | 519.979                             | △0.2   | 99.5             | －              |
| 7 月末              | 9,973       | △0.3   | 520.066                             | △0.2   | 98.6             | －              |
| 8 月末              | 10,024      | 0.2    | 522.848                             | 0.3    | 99.6             | －              |
| 9 月末              | 9,986       | △0.1   | 520.909                             | △0.0   | 99.0             | －              |
| 10月末              | 9,986       | △0.1   | 520.920                             | △0.0   | 99.2             | －              |
| (期末) 2017年11月30日  | 10,010      | 0.1    | 522.295                             | 0.2    | 99.3             | －              |

(注) 騰落率は設定比。

## 投資環境について

(2017.1.11～2017.11.30)

### ■国内債券市況

設定当初から、シリアや北朝鮮をめぐる地政学リスクの高まりを背景に市場のリスク回避姿勢が強まり国内長期金利は低下する一方で、金融緩和の縮小観測などを背景に欧米の長期金利が上昇したことに連れて国内長期金利も上昇するなど、金利は一定の範囲内での動きを繰り返しました。

## ポートフォリオについて

(2017.1.11～2017.11.30)

### ■当ファンド

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

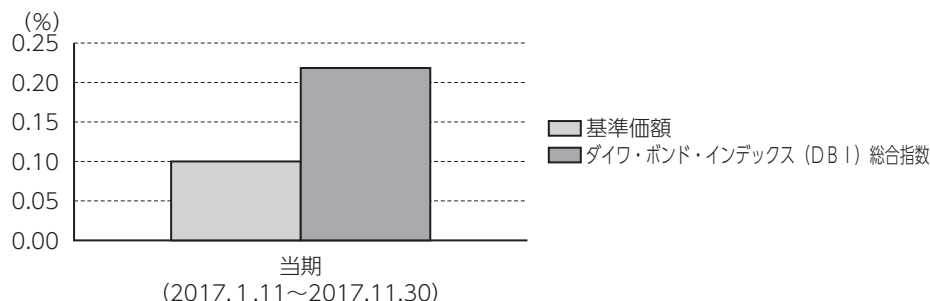
### ■日本債券インデックスマザーファンド

当ファンドの騰落率が、ベンチマーク（ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数）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ないました。期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行な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ないました。

## ベンチマークとの差異について

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

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

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項 目        |     | 当 期                        |
|------------|-----|----------------------------|
|            |     | 2017年1月11日<br>～2017年11月30日 |
| 当期分配金（税込み） | (円) | —                          |
| 対基準価額比率    | (%) | —                          |
| 当期の収益      | (円) | —                          |
| 当期の収益以外    | (円) | —                          |
| 翌期繰越分配対象額  | (円) | 19                         |

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■日本債券インデックスマザーファンド

今後も、ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行ないます。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド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なわれるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目       | 当期<br>(2017.1.11~2017.11.30) |         | 項 目 の 概 要                                                          |
|-----------|------------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------|
|           | 金 額                          | 比 率     |                                                                    |
| 信 託 報 酬   | 10円                          | 0.096%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は9,988円です。                        |
| (投 信 会 社) | (6)                          | (0.062) | 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、目<br>論見書・運用報告書の作成等の対価         |
| (販 売 会 社) | (2)                          | (0.024) | 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<br>の情報提供等の対価                |
| (受 託 銀 行) | (1)                          | (0.010) | 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＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<br>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＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>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 | 0                            | 0.004   | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数                                          |
| (監 査 費 用) | (0)                          | (0.004) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                        |
| 合 計       | 10                           | 0.100   |                                                                    |

(注 1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 比率欄は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年1月11日から2017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     |
| 日本債券インデックス<br>マザーファンド | 997,460 | 1,386,732 | 8,990 | 12,504 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

| 決 算 期   | 当 期       |                        |     |           |                        |     |
|---------|-----------|------------------------|-----|-----------|------------------------|-----|
| 区 分     | 買付額等<br>A | うち利害<br>関係人との<br>取引状況B | B/A | 売付額等<br>C | うち利害<br>関係人との<br>取引状況D | D/C |
|         | 百万円       | 百万円                    | %   | 百万円       | 百万円                    | %   |
| 公社債     | 23,078    | 2,109                  | 9.1 | 8,969     | 726                    | 8.1 |
| コール・ローン | 69,223    | —                      | —   | —         | —                      | —   |

(注) 平均保有割合1.1%

※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) 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

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

| 設定時保有額 | 期中設定額 | 期中解約額 | 期末保有額 | 取引の理由            |
|--------|-------|-------|-------|------------------|
| 百万円    | 百万円   | 百万円   | 百万円   |                  |
| 1      | —     | 1     | —     | 当初設定時における取得とその処分 |

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

| 種 類               | 当 期 末   |           |
|-------------------|---------|-----------|
|                   | 口 数     | 評 価 額     |
|                   | 千口      | 千円        |
| 日本債券インデックスマザーファンド | 988,470 | 1,377,630 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

| 項 目               | 当 期 末     |       |
|-------------------|-----------|-------|
|                   | 評 価 額     | 比 率   |
|                   | 千円        | %     |
| 日本債券インデックスマザーファンド | 1,377,630 | 99.7  |
| コール・ローン等、その他      | 4,191     | 0.3   |
| 投資信託財産総額          | 1,381,821 | 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

2017年11月30日現在

| 項 目                    | 当 期 末          |
|------------------------|----------------|
| (A) 資産                 | 1,381,821,898円 |
| コール・ローン等               | 3,272,761      |
| 日本債券インデックスマザーファンド(評価額) | 1,377,630,796  |
| 未収入金                   | 918,341        |
| (B) 負債                 | 2,815,790      |
| 未払解約金                  | 2,339,479      |
| 未払信託報酬                 | 453,699        |
| その他未払費用                | 22,612         |
| (C) 純資産総額(A－B)         | 1,379,006,108  |
| 元本                     | 1,377,639,463  |
| 次期繰越損益金                | 1,366,645      |
| (D) 受益権総口数             | 1,377,639,463口 |
| 1万口当り基準価額(C/D)         | 10,010円        |

\*設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は1,498,842,558円、同解約元本額は122,203,095円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は10,010円です。

■損益の状況

当期 自2017年1月11日 至2017年11月30日

| 項 目                  | 当 期          |
|----------------------|--------------|
| (A) 配当等収益            | △ 761円       |
| 受取利息                 | 32           |
| 支払利息                 | △ 793        |
| (B) 有価証券売買損益         | 3,297,955    |
| 売買益                  | 3,431,896    |
| 売買損                  | △ 133,941    |
| (C) 信託報酬等            | △ 631,956    |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 2,665,238    |
| (E) 追加信託差損益金         | △1,298,593   |
| (配当等相当額)             | (△ 367)      |
| (売買損益相当額)            | (△1,298,226) |
| (F) 合計(D + E)        | 1,366,645    |
| 次期繰越損益金(F)           | 1,366,645    |
| 追加信託差損益金             | △1,298,593   |
| (配当等相当額)             | (△ 367)      |
| (売買損益相当額)            | (△1,298,226) |
| 分配準備積立金              | 2,665,999    |
| 繰越損益金                | △ 761        |

- (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「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

| 項 目                        | 当 期            |
|----------------------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益            | 0円             |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益        | 2,665,999      |
| (c) 収益調整金                  | 0              |
| (d) 分配準備積立金                | 0              |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 2,665,999      |
| (f) 分配金                    | 0              |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e − f)       | 2,665,999      |
| (h) 受益権総口数                 | 1,377,639,463口 |



# 日本債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第18期 (決算日 2017年11月30日)

(計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日)

日本債券インデックスマザーファンドの第18期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

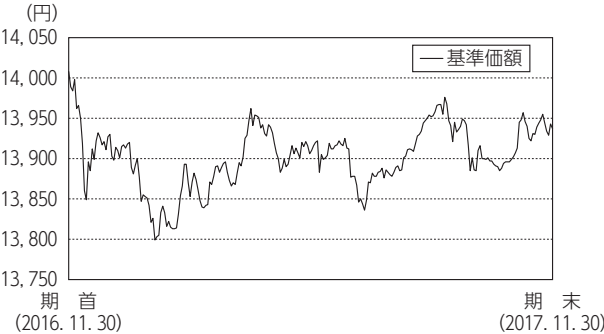
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日            | 基 準 価 額 |       | ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数 (ベンチマーク) |       | 公 社 債 組 入 比 率 |      | 債 券 先 物 比 率 |      |
|------------------|---------|-------|------------------------------------|-------|---------------|------|-------------|------|
|                  | 円       | 騰落率 % | 総合指数                               | 騰落率 % | 比率 %          | 比率 % | 比率 %        | 比率 % |
|                  |         |       |                                    |       |               |      |             |      |
| (期首) 2016年11月30日 | 14,008  | —     | 524.807                            | —     | 98.5          | —    | —           | —    |
| 12月末             | 13,930  | △ 0.6 | 521.909                            | △ 0.6 | 99.3          | —    | —           | —    |
| 2017年 1 月末       | 13,851  | △ 1.1 | 518.958                            | △ 1.1 | 99.3          | —    | —           | —    |
| 2 月末             | 13,893  | △ 0.8 | 520.564                            | △ 0.8 | 99.2          | —    | —           | —    |
| 3 月末             | 13,873  | △ 1.0 | 519.891                            | △ 0.9 | 98.1          | —    | —           | —    |
| 4 月末             | 13,942  | △ 0.5 | 522.469                            | △ 0.4 | 99.6          | —    | —           | —    |
| 5 月末             | 13,916  | △ 0.7 | 521.440                            | △ 0.6 | 99.0          | —    | —           | —    |
| 6 月末             | 13,877  | △ 0.9 | 519.979                            | △ 0.9 | 99.6          | —    | —           | —    |
| 7 月末             | 13,880  | △ 0.9 | 520.066                            | △ 0.9 | 98.7          | —    | —           | —    |
| 8 月末             | 13,953  | △ 0.4 | 522.848                            | △ 0.4 | 99.7          | —    | —           | —    |
| 9 月末             | 13,901  | △ 0.8 | 520.909                            | △ 0.7 | 99.1          | —    | —           | —    |
| 10 月末            | 13,902  | △ 0.8 | 520.920                            | △ 0.7 | 99.3          | —    | —           | —    |
| (期末) 2017年11月30日 | 13,937  | △ 0.5 | 522.295                            | △ 0.5 | 99.4          | —    | —           | —    |

(注1) 騰落率は期首比。  
(注2) ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。  
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。  
(注4) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について  
【基準価額・騰落率】  
期首：14,008円 期末：13,937円 騰落率：△0.5%  
【基準価額の主な変動要因】  
債券からの利息収入を得た一方、金利水準の上昇による債券価格の下落により、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について  
○国内債券市況  
2016年12月から2017年1月にかけて、FOMC (米国連邦公開市場委員会) で政策金利が引き上げられたほか、政策金利の見通しが上方修正されたことで米国の金利が上昇したため、国内長期金利も上昇しました。その後、シリアや北朝鮮をめぐる地政学リスクの高まりを背景に市場のリスク回避姿勢が強まり国内長期金利は低下する一方で、金融緩和の縮小観測などを背景に欧米の長期金利が上昇したことに連れて国内長期金利も上昇するなど、金利は一定の範囲内での動きを繰り返しました。

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

◆ポートフォリオについて  
当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行ないました。期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッドの変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行な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ないました。

◆ベンチマークとの差異について  
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0.0%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。

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

(注) 費用の項目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

|     |       | 買 付 額        | 売 付 額               |
|-----|-------|--------------|---------------------|
|     |       | 千円           | 千円                  |
| 国 内 | 国債証券  | 25, 194, 385 | ( 8, 245, 110<br>—) |
|     | 地方債証券 | 1, 039, 329  | ( 405, 522<br>—)    |
|     | 特殊債券  | 704, 317     | ( 830, 597<br>—)    |
|     | 社債券   | 432, 260     | ( 506, 862<br>—)    |

(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

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

| 当 期                        |             | 期                          |          |
|----------------------------|-------------|----------------------------|----------|
| 買 付                        |             | 売 付                        |          |
| 銘 柄                        | 金 額         | 銘 柄                        | 金 額      |
|                            | 千円          |                            | 千円       |
| 131 5年国債 0. 1% 2022/3/20   | 1, 010, 475 | 368 2年国債 0. 1% 2018/9/15   | 631, 617 |
| 346 10年国債 0. 1% 2027/3/20  | 844, 805    | 366 2年国債 0. 1% 2018/7/15   | 441, 690 |
| 130 5年国債 0. 1% 2021/12/20  | 707, 309    | 371 2年国債 0. 1% 2018/12/15  | 381, 227 |
| 324 10年国債 0. 8% 2022/6/20  | 586, 156    | 127 5年国債 0. 1% 2021/3/20   | 262, 350 |
| 371 2年国債 0. 1% 2018/12/15  | 583, 765    | 341 10年国債 0. 3% 2025/12/20 | 256, 429 |
| 347 10年国債 0. 1% 2027/6/20  | 572, 679    | 131 5年国債 0. 1% 2022/3/20   | 252, 170 |
| 345 10年国債 0. 1% 2026/12/20 | 571, 739    | 293 10年国債 1. 8% 2018/6/20  | 242, 905 |
| 129 5年国債 0. 1% 2021/9/20   | 504, 938    | 160 20年国債 0. 7% 2037/3/20  | 231, 899 |
| 121 5年国債 0. 1% 2019/9/20   | 502, 884    | 64 政保道路機構 1. 6% 2018/8/29  | 222, 882 |
| 160 20年国債 0. 7% 2037/3/20  | 454, 931    | 332 10年国債 0. 6% 2023/12/20 | 209, 246 |

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

■組入資産明細表

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

| 作成期          | 当          |            |      | 期         |           |      |      | 末 |
|--------------|------------|------------|------|-----------|-----------|------|------|---|
| 区分           | 額面金額       | 評価額        | 組入比率 | うちB格以下組入率 | 残存期間別組入比率 |      |      |   |
|              |            |            |      |           | 5年以上      | 2年以上 | 2年未満 |   |
|              | 千円         | 千円         | %    | %         | %         | %    | %    |   |
| 国債証券         | 52,073,000 | 56,883,147 | 83.5 | —         | 54.9      | 19.7 | 8.9  |   |
| 地方債証券        | 4,250,000  | 4,405,150  | 6.5  | —         | 2.9       | 2.7  | 0.8  |   |
| 特殊債券（除く金融債券） | 3,000,000  | 3,112,472  | 4.6  | —         | 2.4       | 2.0  | 0.1  |   |
| 金融債券         | 100,000    | 98,784     | 0.1  | —         | 0.1       | —    | —    |   |
| 普通社債券        | 3,100,000  | 3,212,890  | 4.7  | —         | 1.2       | 2.0  | 1.5  |   |
| 合計           | 62,523,000 | 67,712,446 | 99.4 | —         | 61.6      | 26.3 | 11.4 |   |

(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）

| 当    |           | 期      | 末       |         |            |
|------|-----------|--------|---------|---------|------------|
| 区分   | 銘柄        | 年利率    | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
|      |           | %      | 千円      | 千円      |            |
| 国債証券 | 371 2年国債  | 0.1000 | 200,000 | 200,546 | 2018/12/15 |
|      | 116 5年国債  | 0.2000 | 500,000 | 501,880 | 2018/12/20 |
|      | 297 10年国債 | 1.4000 | 70,000  | 71,141  | 2018/12/20 |
|      | 298 10年国債 | 1.3000 | 125,000 | 126,907 | 2018/12/20 |
|      | 372 2年国債  | 0.1000 | 130,000 | 130,384 | 2019/01/15 |
|      | 373 2年国債  | 0.1000 | 300,000 | 300,954 | 2019/02/15 |
|      | 374 2年国債  | 0.1000 | 320,000 | 321,084 | 2019/03/15 |
|      | 117 5年国債  | 0.2000 | 730,000 | 733,299 | 2019/03/20 |
|      | 299 10年国債 | 1.3000 | 250,000 | 254,685 | 2019/03/20 |
|      | 300 10年国債 | 1.5000 | 286,000 | 292,100 | 2019/03/20 |
|      | 41 20年国債  | 1.5000 | 136,000 | 138,909 | 2019/03/20 |
|      | 42 20年国債  | 2.6000 | 87,000  | 90,092  | 2019/03/20 |
|      | 375 2年国債  | 0.1000 | 60,000  | 60,216  | 2019/04/15 |
|      | 376 2年国債  | 0.1000 | 250,000 | 250,957 | 2019/05/15 |
|      | 377 2年国債  | 0.1000 | 150,000 | 150,609 | 2019/06/15 |
|      | 118 5年国債  | 0.2000 | 270,000 | 271,460 | 2019/06/20 |
|      | 119 5年国債  | 0.1000 | 480,000 | 481,852 | 2019/06/20 |
|      | 301 10年国債 | 1.5000 | 120,000 | 123,060 | 2019/06/20 |
|      | 302 10年国債 | 1.4000 | 240,000 | 245,750 | 2019/06/20 |
|      | 380 2年国債  | 0.1000 | 330,000 | 331,560 | 2019/09/15 |
|      | 120 5年国債  | 0.2000 | 180,000 | 181,132 | 2019/09/20 |
|      | 121 5年国債  | 0.1000 | 550,000 | 552,469 | 2019/09/20 |
|      | 303 10年国債 | 1.4000 | 60,000  | 61,673  | 2019/09/20 |
|      | 304 10年国債 | 1.3000 | 110,000 | 112,869 | 2019/09/20 |
|      | 43 20年国債  | 2.9000 | 100,000 | 105,488 | 2019/09/20 |
|      | 122 5年国債  | 0.1000 | 630,000 | 633,162 | 2019/12/20 |
|      | 305 10年国債 | 1.3000 | 500,000 | 514,810 | 2019/12/20 |
|      | 123 5年国債  | 0.1000 | 580,000 | 583,265 | 2020/03/20 |
|      | 306 10年国債 | 1.4000 | 255,000 | 264,021 | 2020/03/20 |
|      | 307 10年国債 | 1.3000 | 400,000 | 413,232 | 2020/03/20 |

| 区 分 | 当         | 期        | 末         |           |            |
|-----|-----------|----------|-----------|-----------|------------|
|     | 銘 柄       | 年 利 率    | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償還年月日      |
|     | 44 20年国債  | 2.5000 % | 85,000 千円 | 90,156 千円 | 2020/03/20 |
|     | 45 20年国債  | 2.4000   | 78,000    | 82,552    | 2020/03/20 |
|     | 124 5年国債  | 0.1000   | 550,000   | 553,366   | 2020/06/20 |
|     | 308 10年国債 | 1.3000   | 200,000   | 207,322   | 2020/06/20 |
|     | 309 10年国債 | 1.1000   | 90,000    | 92,835    | 2020/06/20 |
|     | 46 20年国債  | 2.2000   | 73,000    | 77,357    | 2020/06/22 |
|     | 125 5年国債  | 0.1000   | 640,000   | 644,396   | 2020/09/20 |
|     | 310 10年国債 | 1.0000   | 130,000   | 134,119   | 2020/09/20 |
|     | 311 10年国債 | 0.8000   | 150,000   | 153,912   | 2020/09/20 |
|     | 47 20年国債  | 2.2000   | 89,000    | 94,821    | 2020/09/21 |
|     | 126 5年国債  | 0.1000   | 750,000   | 755,385   | 2020/12/20 |
|     | 312 10年国債 | 1.2000   | 395,000   | 411,052   | 2020/12/20 |
|     | 48 20年国債  | 2.5000   | 54,000    | 58,352    | 2020/12/21 |
|     | 127 5年国債  | 0.1000   | 680,000   | 685,276   | 2021/03/20 |
|     | 313 10年国債 | 1.3000   | 200,000   | 209,450   | 2021/03/20 |
|     | 314 10年国債 | 1.1000   | 260,000   | 270,566   | 2021/03/20 |
|     | 49 20年国債  | 2.1000   | 64,000    | 68,735    | 2021/03/22 |
|     | 50 20年国債  | 1.9000   | 107,000   | 114,208   | 2021/03/22 |
|     | 128 5年国債  | 0.1000   | 605,000   | 609,948   | 2021/06/20 |
|     | 315 10年国債 | 1.2000   | 221,000   | 231,417   | 2021/06/20 |
|     | 316 10年国債 | 1.1000   | 250,000   | 260,895   | 2021/06/20 |
|     | 51 20年国債  | 2.0000   | 82,000    | 88,204    | 2021/06/21 |
|     | 129 5年国債  | 0.1000   | 830,000   | 837,279   | 2021/09/20 |
|     | 317 10年国債 | 1.1000   | 214,000   | 223,993   | 2021/09/20 |
|     | 318 10年国債 | 1.0000   | 200,000   | 208,578   | 2021/09/20 |
|     | 52 20年国債  | 2.1000   | 52,000    | 56,414    | 2021/09/21 |
|     | 130 5年国債  | 0.1000   | 700,000   | 706,538   | 2021/12/20 |
|     | 319 10年国債 | 1.1000   | 100,000   | 104,957   | 2021/12/20 |
|     | 320 10年国債 | 1.0000   | 230,000   | 240,467   | 2021/12/20 |
|     | 53 20年国債  | 2.1000   | 66,000    | 71,953    | 2021/12/20 |
|     | 54 20年国債  | 2.2000   | 65,000    | 71,127    | 2021/12/20 |
|     | 131 5年国債  | 0.1000   | 750,000   | 757,275   | 2022/03/20 |
|     | 321 10年国債 | 1.0000   | 175,000   | 183,491   | 2022/03/20 |
|     | 322 10年国債 | 0.9000   | 130,000   | 135,747   | 2022/03/20 |
|     | 55 20年国債  | 2.0000   | 140,000   | 152,807   | 2022/03/21 |
|     | 132 5年国債  | 0.1000   | 310,000   | 313,112   | 2022/06/20 |
|     | 324 10年国債 | 0.8000   | 410,000   | 427,129   | 2022/06/20 |
|     | 56 20年国債  | 2.0000   | 70,000    | 76,759    | 2022/06/20 |
|     | 133 5年国債  | 0.1000   | 200,000   | 202,120   | 2022/09/20 |
|     | 325 10年国債 | 0.8000   | 310,000   | 323,596   | 2022/09/20 |
|     | 327 10年国債 | 0.8000   | 300,000   | 313,764   | 2022/12/20 |
|     | 59 20年国債  | 1.7000   | 45,000    | 49,118    | 2022/12/20 |
|     | 60 20年国債  | 1.4000   | 10,000    | 10,763    | 2022/12/20 |
|     | 328 10年国債 | 0.6000   | 330,000   | 342,282   | 2023/03/20 |
|     | 61 20年国債  | 1.0000   | 100,000   | 105,878   | 2023/03/20 |
|     | 329 10年国債 | 0.8000   | 355,000   | 372,700   | 2023/06/20 |
|     | 62 20年国債  | 0.8000   | 95,000    | 99,765    | 2023/06/20 |
|     | 63 20年国債  | 1.8000   | 130,000   | 143,765   | 2023/06/20 |
|     | 330 10年国債 | 0.8000   | 262,000   | 275,582   | 2023/09/20 |
|     | 331 10年国債 | 0.6000   | 265,000   | 275,650   | 2023/09/20 |

日本債券インデックスマザーファンド

| 区 分 | 当         | 期       | 末        |          |            |
|-----|-----------|---------|----------|----------|------------|
|     | 銘 柄       | 年 利 率   | 額 面 金 額  | 評 価 額    | 償還年月日      |
|     | 64 20年国債  | 1. 9000 | 90, 000  | 100, 431 | 2023/09/20 |
|     | 332 10年国債 | 0. 6000 | 310, 000 | 322, 899 | 2023/12/20 |
|     | 65 20年国債  | 1. 9000 | 175, 000 | 196, 101 | 2023/12/20 |
|     | 66 20年国債  | 1. 8000 | 135, 000 | 150, 458 | 2023/12/20 |
|     | 333 10年国債 | 0. 6000 | 540, 000 | 563, 214 | 2024/03/20 |
|     | 67 20年国債  | 1. 9000 | 55, 000  | 61, 884  | 2024/03/20 |
|     | 68 20年国債  | 2. 2000 | 120, 000 | 137, 296 | 2024/03/20 |
|     | 69 20年国債  | 2. 1000 | 110, 000 | 125, 160 | 2024/03/20 |
|     | 334 10年国債 | 0. 6000 | 600, 000 | 626, 622 | 2024/06/20 |
|     | 70 20年国債  | 2. 4000 | 83, 000  | 96, 505  | 2024/06/20 |
|     | 71 20年国債  | 2. 2000 | 125, 000 | 143, 696 | 2024/06/20 |
|     | 335 10年国債 | 0. 5000 | 630, 000 | 654, 733 | 2024/09/20 |
|     | 72 20年国債  | 2. 1000 | 175, 000 | 200, 924 | 2024/09/20 |
|     | 336 10年国債 | 0. 5000 | 175, 000 | 182, 124 | 2024/12/20 |
|     | 337 10年国債 | 0. 3000 | 300, 000 | 307, 857 | 2024/12/20 |
|     | 73 20年国債  | 2. 0000 | 120, 000 | 137, 534 | 2024/12/20 |
|     | 74 20年国債  | 2. 1000 | 73, 000  | 84, 183  | 2024/12/20 |
|     | 338 10年国債 | 0. 4000 | 390, 000 | 403, 283 | 2025/03/20 |
|     | 75 20年国債  | 2. 1000 | 80, 000  | 92, 619  | 2025/03/20 |
|     | 76 20年国債  | 1. 9000 | 51, 000  | 58, 298  | 2025/03/20 |
|     | 77 20年国債  | 2. 0000 | 130, 000 | 149, 554 | 2025/03/20 |
|     | 339 10年国債 | 0. 4000 | 440, 000 | 454, 986 | 2025/06/20 |
|     | 78 20年国債  | 1. 9000 | 61, 000  | 69, 979  | 2025/06/20 |
|     | 79 20年国債  | 2. 0000 | 50, 000  | 57, 738  | 2025/06/20 |
|     | 80 20年国債  | 2. 1000 | 53, 000  | 61, 603  | 2025/06/20 |
|     | 340 10年国債 | 0. 4000 | 680, 000 | 703, 392 | 2025/09/20 |
|     | 81 20年国債  | 2. 0000 | 76, 000  | 88, 087  | 2025/09/20 |
|     | 82 20年国債  | 2. 1000 | 87, 000  | 101, 516 | 2025/09/20 |
|     | 341 10年国債 | 0. 3000 | 420, 000 | 431, 172 | 2025/12/20 |
|     | 83 20年国債  | 2. 1000 | 93, 000  | 108, 928 | 2025/12/20 |
|     | 84 20年国債  | 2. 0000 | 100, 000 | 116, 321 | 2025/12/20 |
|     | 342 10年国債 | 0. 1000 | 700, 000 | 707, 266 | 2026/03/20 |
|     | 85 20年国債  | 2. 1000 | 58, 000  | 68, 182  | 2026/03/20 |
|     | 86 20年国債  | 2. 3000 | 80, 000  | 95, 372  | 2026/03/20 |
|     | 87 20年国債  | 2. 2000 | 55, 000  | 65, 112  | 2026/03/20 |
|     | 343 10年国債 | 0. 1000 | 700, 000 | 706, 881 | 2026/06/20 |
|     | 88 20年国債  | 2. 3000 | 100, 000 | 119, 749 | 2026/06/20 |
|     | 89 20年国債  | 2. 2000 | 78, 000  | 92, 737  | 2026/06/20 |
|     | 344 10年国債 | 0. 1000 | 540, 000 | 544, 984 | 2026/09/20 |
|     | 90 20年国債  | 2. 2000 | 120, 000 | 143, 216 | 2026/09/20 |
|     | 91 20年国債  | 2. 3000 | 60, 000  | 72, 136  | 2026/09/20 |
|     | 345 10年国債 | 0. 1000 | 550, 000 | 554, 719 | 2026/12/20 |
|     | 92 20年国債  | 2. 1000 | 280, 000 | 332, 724 | 2026/12/20 |
|     | 346 10年国債 | 0. 1000 | 750, 000 | 755, 910 | 2027/03/20 |
|     | 93 20年国債  | 2. 0000 | 100, 000 | 118, 360 | 2027/03/20 |
|     | 94 20年国債  | 2. 1000 | 130, 000 | 155, 074 | 2027/03/20 |
|     | 347 10年国債 | 0. 1000 | 570, 000 | 574, 337 | 2027/06/20 |
|     | 95 20年国債  | 2. 3000 | 50, 000  | 60, 799  | 2027/06/20 |
|     | 96 20年国債  | 2. 1000 | 155, 000 | 185, 528 | 2027/06/20 |
|     | 348 10年国債 | 0. 1000 | 180, 000 | 181, 229 | 2027/09/20 |

| 区 分 | 当         | 期       | 末        |          |            |
|-----|-----------|---------|----------|----------|------------|
|     | 銘 柄       | 年 利 率   | 額 面 金 額  | 評 価 額    | 償還年月日      |
|     |           | %       | 千円       | 千円       |            |
|     | 97 20年国債  | 2. 2000 | 40, 000  | 48, 452  | 2027/09/20 |
|     | 98 20年国債  | 2. 1000 | 120, 000 | 144, 187 | 2027/09/20 |
|     | 99 20年国債  | 2. 1000 | 200, 000 | 241, 214 | 2027/12/20 |
|     | 100 20年国債 | 2. 2000 | 55, 000  | 67, 106  | 2028/03/20 |
|     | 101 20年国債 | 2. 4000 | 75, 000  | 93, 043  | 2028/03/20 |
|     | 102 20年国債 | 2. 4000 | 80, 000  | 99, 559  | 2028/06/20 |
|     | 103 20年国債 | 2. 3000 | 70, 000  | 86, 381  | 2028/06/20 |
|     | 104 20年国債 | 2. 1000 | 110, 000 | 133, 437 | 2028/06/20 |
|     | 105 20年国債 | 2. 1000 | 126, 000 | 153, 320 | 2028/09/20 |
|     | 106 20年国債 | 2. 2000 | 150, 000 | 184, 131 | 2028/09/20 |
|     | 107 20年国債 | 2. 1000 | 107, 000 | 130, 589 | 2028/12/20 |
|     | 108 20年国債 | 1. 9000 | 177, 000 | 212, 031 | 2028/12/20 |
|     | 109 20年国債 | 1. 9000 | 35, 000  | 42, 056  | 2029/03/20 |
|     | 110 20年国債 | 2. 1000 | 130, 000 | 159, 116 | 2029/03/20 |
|     | 111 20年国債 | 2. 2000 | 100, 000 | 123, 891 | 2029/06/20 |
|     | 112 20年国債 | 2. 1000 | 170, 000 | 208, 676 | 2029/06/20 |
|     | 1 30年国債   | 2. 8000 | 16, 000  | 20, 986  | 2029/09/20 |
|     | 113 20年国債 | 2. 1000 | 230, 000 | 282, 962 | 2029/09/20 |
|     | 114 20年国債 | 2. 1000 | 130, 000 | 160, 368 | 2029/12/20 |
|     | 115 20年国債 | 2. 2000 | 160, 000 | 199, 273 | 2029/12/20 |
|     | 2 30年国債   | 2. 4000 | 24, 000  | 30, 531  | 2030/02/20 |
|     | 116 20年国債 | 2. 2000 | 89, 000  | 111, 151 | 2030/03/20 |
|     | 117 20年国債 | 2. 1000 | 215, 000 | 265, 914 | 2030/03/20 |
|     | 3 30年国債   | 2. 3000 | 30, 000  | 37, 887  | 2030/05/20 |
|     | 118 20年国債 | 2. 0000 | 95, 000  | 116, 564 | 2030/06/20 |
|     | 119 20年国債 | 1. 8000 | 93, 000  | 111, 752 | 2030/06/20 |
|     | 120 20年国債 | 1. 6000 | 210, 000 | 247, 180 | 2030/06/20 |
|     | 121 20年国債 | 1. 9000 | 135, 000 | 164, 245 | 2030/09/20 |
|     | 122 20年国債 | 1. 8000 | 160, 000 | 192, 657 | 2030/09/20 |
|     | 4 30年国債   | 2. 9000 | 36, 000  | 48, 463  | 2030/11/20 |
|     | 123 20年国債 | 2. 1000 | 140, 000 | 174, 256 | 2030/12/20 |
|     | 124 20年国債 | 2. 0000 | 143, 000 | 176, 168 | 2030/12/20 |
|     | 125 20年国債 | 2. 2000 | 85, 000  | 107, 146 | 2031/03/20 |
|     | 126 20年国債 | 2. 0000 | 70, 000  | 86, 368  | 2031/03/20 |
|     | 127 20年国債 | 1. 9000 | 165, 000 | 201, 443 | 2031/03/20 |
|     | 5 30年国債   | 2. 2000 | 28, 000  | 35, 361  | 2031/05/20 |
|     | 128 20年国債 | 1. 9000 | 119, 000 | 145, 577 | 2031/06/20 |
|     | 129 20年国債 | 1. 8000 | 160, 000 | 193, 625 | 2031/06/20 |
|     | 130 20年国債 | 1. 8000 | 140, 000 | 169, 727 | 2031/09/20 |
|     | 131 20年国債 | 1. 7000 | 130, 000 | 155, 758 | 2031/09/20 |
|     | 6 30年国債   | 2. 4000 | 24, 000  | 31, 086  | 2031/11/20 |
|     | 132 20年国債 | 1. 7000 | 120, 000 | 143, 997 | 2031/12/20 |
|     | 133 20年国債 | 1. 8000 | 210, 000 | 254, 851 | 2031/12/20 |
|     | 134 20年国債 | 1. 8000 | 50, 000  | 60, 776  | 2032/03/20 |
|     | 135 20年国債 | 1. 7000 | 92, 000  | 110, 481 | 2032/03/20 |
|     | 136 20年国債 | 1. 6000 | 155, 000 | 183, 997 | 2032/03/20 |
|     | 7 30年国債   | 2. 3000 | 55, 000  | 70, 830  | 2032/05/20 |
|     | 137 20年国債 | 1. 7000 | 85, 000  | 102, 222 | 2032/06/20 |
|     | 138 20年国債 | 1. 5000 | 87, 000  | 102, 116 | 2032/06/20 |
|     | 139 20年国債 | 1. 6000 | 125, 000 | 148, 575 | 2032/06/20 |



日本債券インデックスマザーファンド

| 区 分 | 当         | 期      | 末             |               |            |
|-----|-----------|--------|---------------|---------------|------------|
|     | 銘 柄       | 年 利 率  | 額 面 金 額       | 評 価 額         | 償還年月日      |
|     | 140 20年国債 | 1.7000 | 千円<br>335,000 | 千円<br>403,437 | 2032/09/20 |
|     | 8 30年国債   | 1.8000 | 27,000        | 32,942        | 2032/11/22 |
|     | 9 30年国債   | 1.4000 | 43,000        | 49,952        | 2032/12/20 |
|     | 141 20年国債 | 1.7000 | 170,000       | 204,846       | 2032/12/20 |
|     | 142 20年国債 | 1.8000 | 150,000       | 183,045       | 2032/12/20 |
|     | 10 30年国債  | 1.1000 | 45,000        | 50,262        | 2033/03/20 |
|     | 143 20年国債 | 1.6000 | 210,000       | 250,275       | 2033/03/20 |
|     | 144 20年国債 | 1.5000 | 120,000       | 141,154       | 2033/03/20 |
|     | 11 30年国債  | 1.7000 | 40,000        | 48,316        | 2033/06/20 |
|     | 145 20年国債 | 1.7000 | 285,000       | 343,995       | 2033/06/20 |
|     | 12 30年国債  | 2.1000 | 60,000        | 76,171        | 2033/09/20 |
|     | 146 20年国債 | 1.7000 | 275,000       | 332,304       | 2033/09/20 |
|     | 13 30年国債  | 2.0000 | 75,000        | 94,155        | 2033/12/20 |
|     | 147 20年国債 | 1.6000 | 170,000       | 202,896       | 2033/12/20 |
|     | 14 30年国債  | 2.4000 | 82,000        | 108,240       | 2034/03/20 |
|     | 148 20年国債 | 1.5000 | 245,000       | 288,644       | 2034/03/20 |
|     | 15 30年国債  | 2.5000 | 100,000       | 133,829       | 2034/06/20 |
|     | 149 20年国債 | 1.5000 | 232,000       | 273,291       | 2034/06/20 |
|     | 16 30年国債  | 2.5000 | 100,000       | 133,997       | 2034/09/20 |
|     | 150 20年国債 | 1.4000 | 250,000       | 290,485       | 2034/09/20 |
|     | 17 30年国債  | 2.4000 | 80,000        | 106,121       | 2034/12/20 |
|     | 151 20年国債 | 1.2000 | 300,000       | 338,562       | 2034/12/20 |
|     | 18 30年国債  | 2.3000 | 80,000        | 104,835       | 2035/03/20 |
|     | 152 20年国債 | 1.2000 | 280,000       | 315,714       | 2035/03/20 |
|     | 19 30年国債  | 2.3000 | 57,000        | 74,813        | 2035/06/20 |
|     | 153 20年国債 | 1.3000 | 315,000       | 360,290       | 2035/06/20 |
|     | 20 30年国債  | 2.5000 | 60,000        | 80,863        | 2035/09/20 |
|     | 154 20年国債 | 1.2000 | 300,000       | 337,902       | 2035/09/20 |
|     | 21 30年国債  | 2.3000 | 60,000        | 78,919        | 2035/12/20 |
|     | 155 20年国債 | 1.0000 | 240,000       | 261,808       | 2035/12/20 |
|     | 22 30年国債  | 2.5000 | 70,000        | 94,650        | 2036/03/20 |
|     | 156 20年国債 | 0.4000 | 273,000       | 268,874       | 2036/03/20 |
|     | 23 30年国債  | 2.5000 | 60,000        | 81,189        | 2036/06/20 |
|     | 157 20年国債 | 0.2000 | 323,000       | 305,777       | 2036/06/20 |
|     | 24 30年国債  | 2.5000 | 92,000        | 124,682       | 2036/09/20 |
|     | 158 20年国債 | 0.5000 | 153,000       | 152,605       | 2036/09/20 |
|     | 25 30年国債  | 2.3000 | 150,000       | 197,980       | 2036/12/20 |
|     | 159 20年国債 | 0.6000 | 230,000       | 232,985       | 2036/12/20 |
|     | 26 30年国債  | 2.4000 | 150,000       | 200,847       | 2037/03/20 |
|     | 160 20年国債 | 0.7000 | 220,000       | 226,347       | 2037/03/20 |
|     | 161 20年国債 | 0.6000 | 250,000       | 251,982       | 2037/06/20 |
|     | 27 30年国債  | 2.5000 | 150,000       | 204,219       | 2037/09/20 |
|     | 162 20年国債 | 0.6000 | 200,000       | 201,246       | 2037/09/20 |
|     | 28 30年国債  | 2.5000 | 150,000       | 204,886       | 2038/03/20 |
|     | 29 30年国債  | 2.4000 | 200,000       | 270,050       | 2038/09/20 |
|     | 30 30年国債  | 2.3000 | 177,000       | 236,257       | 2039/03/20 |
|     | 31 30年国債  | 2.2000 | 165,000       | 217,560       | 2039/09/20 |
|     | 32 30年国債  | 2.3000 | 200,000       | 268,430       | 2040/03/20 |
|     | 33 30年国債  | 2.0000 | 261,000       | 334,604       | 2040/09/20 |
|     | 34 30年国債  | 2.2000 | 213,000       | 282,640       | 2041/03/20 |

| 当       |            | 期        | 末          |            |            |
|---------|------------|----------|------------|------------|------------|
| 区 分     | 銘 柄        | 年 利 率    | 額 面 金 額    | 評 価 額      | 償還年月日      |
|         | 35 30年国債   | 2.0000 % | 250,000 千円 | 321,535 千円 | 2041/09/20 |
|         | 36 30年国債   | 2.0000   | 226,000    | 291,225    | 2042/03/20 |
|         | 37 30年国債   | 1.9000   | 290,000    | 367,795    | 2042/09/20 |
|         | 38 30年国債   | 1.8000   | 159,000    | 198,284    | 2043/03/20 |
|         | 39 30年国債   | 1.9000   | 152,000    | 193,196    | 2043/06/20 |
|         | 40 30年国債   | 1.8000   | 140,000    | 174,792    | 2043/09/20 |
|         | 41 30年国債   | 1.7000   | 140,000    | 171,593    | 2043/12/20 |
|         | 42 30年国債   | 1.7000   | 146,000    | 179,013    | 2044/03/20 |
|         | 43 30年国債   | 1.7000   | 160,000    | 196,252    | 2044/06/20 |
|         | 44 30年国債   | 1.7000   | 140,000    | 171,781    | 2044/09/20 |
|         | 45 30年国債   | 1.5000   | 168,000    | 198,110    | 2044/12/20 |
|         | 46 30年国債   | 1.5000   | 180,000    | 212,508    | 2045/03/20 |
|         | 47 30年国債   | 1.6000   | 167,000    | 201,240    | 2045/06/20 |
|         | 48 30年国債   | 1.4000   | 190,000    | 219,413    | 2045/09/20 |
|         | 49 30年国債   | 1.4000   | 173,000    | 199,749    | 2045/12/20 |
|         | 50 30年国債   | 0.8000   | 185,000    | 185,212    | 2046/03/20 |
|         | 51 30年国債   | 0.3000   | 190,000    | 165,805    | 2046/06/20 |
|         | 52 30年国債   | 0.5000   | 205,000    | 189,057    | 2046/09/20 |
|         | 53 30年国債   | 0.6000   | 195,000    | 184,719    | 2046/12/20 |
|         | 54 30年国債   | 0.8000   | 188,000    | 187,332    | 2047/03/20 |
|         | 55 30年国債   | 0.8000   | 190,000    | 189,319    | 2047/06/20 |
|         | 56 30年国債   | 0.8000   | 130,000    | 129,377    | 2047/09/20 |
|         | 1 40年国債    | 2.4000   | 85,000     | 120,660    | 2048/03/20 |
|         | 2 40年国債    | 2.2000   | 116,000    | 159,029    | 2049/03/20 |
|         | 3 40年国債    | 2.2000   | 74,000     | 101,892    | 2050/03/20 |
|         | 4 40年国債    | 2.2000   | 107,000    | 147,740    | 2051/03/20 |
|         | 5 40年国債    | 2.0000   | 125,000    | 165,585    | 2052/03/20 |
|         | 6 40年国債    | 1.9000   | 105,000    | 136,223    | 2053/03/20 |
|         | 7 40年国債    | 1.7000   | 121,000    | 149,732    | 2054/03/20 |
|         | 8 40年国債    | 1.4000   | 150,000    | 171,418    | 2055/03/20 |
|         | 9 40年国債    | 0.4000   | 258,000    | 211,621    | 2056/03/20 |
|         | 10 40年国債   | 0.9000   | 165,000    | 160,571    | 2057/03/20 |
| 種 別 小 計 | 銘 柄 数      | 262銘柄    |            |            |            |
|         | 金 額        |          | 52,073,000 | 56,883,147 |            |
| 地方債証券   |            |          |            |            |            |
|         | 665 東京都公債  | 1.4300   | 100,000    | 101,485    | 2018/12/20 |
|         | 21-2 千葉県公債 | 1.5700   | 100,000    | 102,270    | 2019/05/24 |
|         | 163 神奈川県公債 | 1.4000   | 100,000    | 102,120    | 2019/06/20 |
|         | 21-3 埼玉県公債 | 1.6400   | 100,000    | 102,510    | 2019/06/25 |
|         | 76 共同発行地方  | 1.4000   | 50,000     | 51,125     | 2019/07/25 |
|         | 21-6 千葉県公債 | 1.4100   | 100,000    | 102,498    | 2019/09/25 |
|         | 81 共同発行地方  | 1.3200   | 100,000    | 102,655    | 2019/12/25 |
|         | 21-3 広島市公債 | 1.3400   | 100,000    | 102,697    | 2019/12/25 |
|         | 21-5 京都市公債 | 1.4500   | 100,000    | 103,156    | 2020/02/25 |
|         | 471 名古屋市債  | 1.2700   | 100,000    | 103,134    | 2020/06/19 |
|         | 688 東京都公債  | 0.9400   | 100,000    | 102,512    | 2020/09/18 |
|         | 90 共同発行地方  | 1.1200   | 100,000    | 103,018    | 2020/09/25 |
|         | 22-1 岡山県公債 | 1.0500   | 100,000    | 103,017    | 2020/11/30 |
|         | 22-5 京都府公債 | 1.2600   | 100,000    | 103,716    | 2020/12/21 |
|         | 699 東京都公債  | 1.0200   | 100,000    | 103,758    | 2021/09/17 |

日本債券インデックスマザーファンド

| 当            |             | 期      | 末         |           |            |
|--------------|-------------|--------|-----------|-----------|------------|
| 区 分          | 銘 柄         | 年 利 率  | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償還年月日      |
|              | 23-2 島根県公債  | 1.0300 | 100,000   | 103,941   | 2021/11/25 |
|              | 108 共同発行地方  | 1.0100 | 100,000   | 104,175   | 2022/03/25 |
|              | 24-1 北海道公債  | 0.9900 | 100,000   | 104,123   | 2022/04/27 |
|              | 24-5 札幌市公債  | 0.8300 | 100,000   | 103,585   | 2022/06/20 |
|              | 361 大阪府公債   | 0.9200 | 100,000   | 103,955   | 2022/06/28 |
|              | 24-6 北海道公債  | 0.8400 | 100,000   | 103,695   | 2022/08/31 |
|              | 713 東京都公債   | 0.7700 | 100,000   | 103,481   | 2022/09/20 |
|              | 24-5 京都府公債  | 0.8200 | 100,000   | 103,701   | 2022/09/20 |
|              | 24-10 神戸市公債 | 0.7960 | 100,000   | 103,628   | 2022/10/21 |
|              | 117 共同発行地方  | 0.7200 | 100,000   | 103,391   | 2022/12/22 |
|              | 24-3 横浜市公債  | 0.7290 | 100,000   | 103,431   | 2022/12/22 |
|              | 24-16 愛知県公債 | 0.7570 | 100,000   | 103,633   | 2023/01/31 |
|              | 24-4 福井県公債  | 0.4600 | 100,000   | 102,115   | 2023/04/26 |
|              | 126 共同発行地方  | 0.8100 | 100,000   | 104,299   | 2023/09/25 |
|              | 25-6 大阪市公債  | 0.6940 | 200,000   | 207,313   | 2023/11/22 |
|              | 131 共同発行地方  | 0.6600 | 100,000   | 103,608   | 2024/02/23 |
|              | 26-10 静岡県公債 | 0.5150 | 100,000   | 102,982   | 2024/11/25 |
|              | 26-17 兵庫県公債 | 0.4600 | 100,000   | 102,573   | 2025/02/26 |
|              | 3 兵庫県公債12年  | 0.5600 | 200,000   | 206,608   | 2025/04/16 |
|              | 751 東京都公債   | 0.3700 | 100,000   | 102,001   | 2025/12/19 |
|              | 420 大阪府公債   | 0.1700 | 200,000   | 199,496   | 2027/05/28 |
|              | 29-1 福岡県公債  | 0.2000 | 100,000   | 100,122   | 2027/06/23 |
|              | 19兵庫県公債20年  | 1.5700 | 100,000   | 116,231   | 2033/12/09 |
|              | 16 千葉県20年   | 1.5550 | 100,000   | 116,411   | 2034/04/14 |
|              | 31 神奈川県20年  | 1.0020 | 100,000   | 106,966   | 2035/12/20 |
| 種 別 小 計      | 銘 柄 数       | 40銘柄   |           |           |            |
|              | 金 額         |        | 4,250,000 | 4,405,150 |            |
| 特殊債券（除く金融債券） | 24 政保中日本道   | 1.3000 | 100,000   | 101,483   | 2019/01/22 |
|              | 14政保地方公共6   | 0.1990 | 100,000   | 100,468   | 2020/06/18 |
|              | 61 道路機構     | 1.2400 | 100,000   | 103,015   | 2020/06/19 |
|              | 13 地方公共団体   | 1.2780 | 100,000   | 103,153   | 2020/06/26 |
|              | 110 政保道路機構  | 1.3000 | 100,000   | 103,313   | 2020/06/30 |
|              | 3 公営企業15年   | 2.2000 | 100,000   | 107,589   | 2021/05/21 |
|              | 29 地方公共団体   | 1.0250 | 100,000   | 103,792   | 2021/10/28 |
|              | 81 道路機構     | 1.0300 | 100,000   | 103,789   | 2021/12/20 |
|              | 33 地方公共団体   | 1.0350 | 100,000   | 104,147   | 2022/02/28 |
|              | 25 日本政策金融   | 0.9970 | 100,000   | 104,006   | 2022/05/10 |
|              | 168 政保道路機構  | 0.8390 | 100,000   | 103,865   | 2022/07/29 |
|              | 39政保地方公共団   | 0.8010 | 100,000   | 103,721   | 2022/08/15 |
|              | 173 政保道路機構  | 0.8190 | 100,000   | 103,900   | 2022/09/30 |
|              | 175 政保道路機構  | 0.7910 | 100,000   | 103,840   | 2022/10/31 |
|              | 25 政保日本政策   | 0.8150 | 100,000   | 104,181   | 2023/02/24 |
|              | 19 政保政策投資 C | 0.6680 | 100,000   | 103,435   | 2023/03/15 |
|              | 186 政保道路機構  | 0.6680 | 100,000   | 103,449   | 2023/03/17 |
|              | 48 地方公共団体   | 0.8130 | 100,000   | 103,982   | 2023/05/26 |
|              | 190 政保道路機構  | 0.6050 | 100,000   | 103,191   | 2023/05/31 |
|              | 51 地方公共団体   | 0.8410 | 100,000   | 104,313   | 2023/08/28 |
|              | 65 地方公共団体   | 0.5350 | 100,000   | 102,941   | 2024/10/28 |
|              | 236 政保道路機構  | 0.3200 | 100,000   | 102,021   | 2025/01/31 |

| 当       |                 | 期          |         | 末          |            |            |
|---------|-----------------|------------|---------|------------|------------|------------|
| 区 分     |                 | 銘 柄        | 年 利 率   | 額 面 金 額    | 評 価 額      | 償還年月日      |
|         |                 | 71 地方公共団体  | 0.4650  | 100,000    | 102,562    | 2025/04/28 |
|         |                 | 261 政保道路機構 | 0.3810  | 200,000    | 204,847    | 2025/11/28 |
|         |                 | F143地方公共団体 | 1.3510  | 100,000    | 110,958    | 2027/08/25 |
|         |                 | 1 地方公共団15年 | 1.3340  | 100,000    | 111,039    | 2028/01/28 |
|         |                 | 86 政保道路機構  | 2.0000  | 100,000    | 120,509    | 2029/07/31 |
|         |                 | 284 政保道路機構 | 0.1490  | 200,000    | 184,952    | 2036/07/31 |
|         |                 | 種 別 小 計    | 銘 柄 数   | 28銘柄       |            |            |
| 金 額     |                 |            |         | 3,000,000  | 3,112,472  |            |
| 金融債券    |                 | 19 利付商工債   | 0.1000  | 100,000    | 98,784     | 2026/09/18 |
| 種 別 小 計 | 銘 柄 数           | 1銘柄        |         |            |            |            |
|         | 金 額             |            |         | 100,000    | 98,784     |            |
| 普通社債券   |                 | 18 西日本旅客鉄  | 1.7000  | 100,000    | 101,725    | 2018/12/11 |
|         | 4 リソな銀行劣後       | 2.7660     | 100,000 | 104,117    | 2019/06/20 |            |
|         | 46 NTT ファイナンス   | 0.2500     | 100,000 | 100,333    | 2019/06/20 |            |
|         | 14 武田薬品         | 0.5400     | 100,000 | 100,783    | 2019/07/19 |            |
|         | 20 三井住友 BK 劣    | 2.2100     | 100,000 | 103,487    | 2019/07/24 |            |
|         | 164 オリックス       | 1.1460     | 100,000 | 101,821    | 2019/08/07 |            |
|         | 24 太平洋セメント      | 0.3900     | 100,000 | 100,442    | 2019/09/11 |            |
|         | 423 九州電力        | 0.9590     | 100,000 | 101,650    | 2019/09/25 |            |
|         | 62東日本旅客鉄道       | 1.4240     | 100,000 | 102,529    | 2019/09/27 |            |
|         | 8ドイツ銀行 AG ロンドン  | 0.4700     | 100,000 | 100,217    | 2019/11/14 |            |
|         | 29 東日本高速道       | 0.1800     | 100,000 | 100,257    | 2020/03/19 |            |
|         | 260 北陸電力        | 2.3300     | 100,000 | 105,627    | 2020/05/25 |            |
|         | 9 AUST・NZ 銀行    | 0.3430     | 100,000 | 100,392    | 2020/07/24 |            |
|         | 20 東京三菱銀行       | 2.5700     | 100,000 | 106,723    | 2020/07/27 |            |
|         | 15 トヨタファイナンス    | 1.8000     | 100,000 | 104,724    | 2020/08/21 |            |
|         | 17 シティグループ・インク  | 2.0400     | 100,000 | 105,128    | 2020/09/16 |            |
|         | 72東日本旅客鉄道       | 1.2800     | 100,000 | 103,695    | 2020/12/22 |            |
|         | 44 野村ホールディング    | 0.7230     | 100,000 | 101,656    | 2021/02/25 |            |
|         | 2 イオンFS         | 0.5720     | 100,000 | 100,638    | 2021/03/18 |            |
|         | 9三菱 UFJ 信託 BK 劣 | 1.6800     | 100,000 | 105,128    | 2021/04/28 |            |
|         | 11 セブンアンドアイ     | 0.5140     | 100,000 | 101,830    | 2022/06/20 |            |
|         | 11三菱 UFJ 信託 BK  | 1.3600     | 100,000 | 105,283    | 2022/06/27 |            |
|         | 372 中国電力        | 1.2040     | 100,000 | 104,967    | 2022/08/25 |            |
|         | 4 JX ホールディングス   | 1.1450     | 100,000 | 104,842    | 2022/12/14 |            |
|         | 30 大阪瓦斯         | 0.7590     | 100,000 | 103,214    | 2022/12/14 |            |
|         | 175 オリックス       | 1.0640     | 100,000 | 104,500    | 2023/11/24 |            |
|         | 21 西日本高速道       | 0.7540     | 100,000 | 103,586    | 2023/12/20 |            |
|         | 1 三菱 UFJFG 劣後   | 0.9400     | 100,000 | 103,503    | 2024/06/26 |            |
|         | 20 成田国際空港       | 0.1050     | 100,000 | 99,126     | 2026/08/21 |            |
|         | 41 東海旅客鉄道       | 2.1660     | 100,000 | 120,258    | 2029/01/29 |            |
|         | 107東日本旅客鉄       | 1.4150     | 100,000 | 110,697    | 2045/01/27 |            |
| 種 別 小 計 | 銘 柄 数           | 31銘柄       |         |            |            |            |
|         | 金 額             |            |         | 3,100,000  | 3,212,890  |            |
| 合 計     | 銘 柄 数           | 362銘柄      |         |            |            |            |
|         | 金 額             |            |         | 62,523,000 | 67,712,446 |            |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

| 項 目          | 2017年11月30日現在 |       |
|--------------|---------------|-------|
|              | 当 期 末         |       |
|              | 評 価 額         | 比 率   |
|              | 千円            | %     |
| 公社債          | 67,712,446    | 99.2  |
| コール・ローン等、その他 | 515,486       | 0.8   |
| 投資信託財産総額     | 68,227,933    | 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

| 2017年11月30日現在  |                 |
|----------------|-----------------|
| 項 目            | 当 期 末           |
| (A) 資産         | 68,227,933,193円 |
| コール・ローン等       | 328,217,271     |
| 公社債（評価額）       | 67,712,446,580  |
| 未収利息           | 181,873,953     |
| 前払費用           | 5,395,389       |
| (B) 負債         | 88,741,204      |
| 未払解約金          | 88,741,204      |
| (C) 純資産総額（A－B） | 68,139,191,989  |
| 元本             | 48,889,824,254  |
| 次期繰越損益金        | 19,249,367,735  |
| (D) 受益権総口数     | 48,889,824,254口 |
| 1万口当り基準価額（C／D） | 13,937円         |

\* 期首における元本額は37,053,043,176円、当期中における追加設定元本額は16,475,959,702円、同解約元本額は4,639,178,624円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）158,413,208円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）1,115,777,521円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）129,471,630円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）1,544,820,823円、D－I's日本債券インデックス761,060円、DCダイワ日本債券インデックス5,048,119,641円、ダイワ・バランスファンド35VA14,793,606,425円、ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）2,332,093,501円、ダイワ国内バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）315,508,234円、ダイワ国内バランスファンド30VA（適格機関投資家専用）427,330,074円、ダイワ・ノーロード日本債券ファンド56,164,883円、ダイワファンドラップ日本債券インデックス13,311,941,351円、ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）17,276,903円、ダイワファンドラップオンライン日本債券インデックス988,470,113円、ダイワ・インデックスセレクト日本債券1,245,052,313円、ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス6,339,363,709円、ダイワライフスタイル25451,259,183円、ダイワライフスタイル50481,361,512円、ダイワライフスタイル75133,032,170円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,937円です。

■損益の状況

| 当期 自 2016年12月1日 至 2017年11月30日 |                 |
|-------------------------------|-----------------|
| 項 目                           | 当 期             |
| (A) 配当等収益                     | 611,733,917円    |
| 受取利息                          | 611,905,675     |
| 支払利息                          | △ 171,758       |
| (B) 有価証券売買損益                  | △ 819,398,131   |
| 売買益                           | 52,133,060      |
| 売買損                           | △ 871,531,191   |
| (C) その他費用                     | △ 2,372         |
| (D) 当期損益金（A＋B＋C）              | △ 207,666,586   |
| (E) 前期繰越損益金                   | 14,852,652,444  |
| (F) 解約差損益金                    | △ 1,815,204,560 |
| (G) 追加信託差損益金                  | 6,419,586,437   |
| (H) 合計（D＋E＋F＋G）               | 19,249,367,735  |
| 次期繰越損益金（H）                    | 19,249,367,735  |

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

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

# ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

★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                                                                                                                                                                                                                                                 |                                 |             |
| 運用方針         | 投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。                                                                                                                                                                                         |                                 |             |
| 主要投資対象       | ベビーファンド                                                                                                                                                                                                                                             | 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの受益証券 |             |
|              | 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド                                                                                                                                                                                                                          | 外国の公社債                          |             |
| マザーファンドの運用方法 | ①主として、外国の公社債に投資し、投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。<br>②運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>③投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させるため、外貨建資産については為替ヘッジを行ないます。 |                                 |             |
| 組入制限         | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率                                                                                                                                                                                                                               |                                 | 無制限         |
|              | ベビーファンドの株式実質組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                  |                                 | 純資産総額の10%以下 |
|              | マザーファンドの株式組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                    |                                 |             |
| 分配方針         | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。                                                                                                                    |                                 |             |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

## 運用報告書（全体版） 第1期

（決算日 2017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。

さて、「ダイワファンドラップオンライン外国債券インデックス（為替ヘッジあり）」は、このたび、第1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

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）

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

設定以来の運用実績

| 決 算 期             | 基 準 価 額     |           |           | シティ世界国債インデックス<br>(除く日本、円ヘッジ・円ベース) |           | 公 社 債<br>組 入 比 率 | 債 券 先 物 率<br>比 | 純 資 産 額<br>総 |
|-------------------|-------------|-----------|-----------|-----------------------------------|-----------|------------------|----------------|--------------|
|                   |             | 税 込 分 配 金 | 期 中 騰 落 率 | (ベンチマーク)                          | 期 中 騰 落 率 |                  |                |              |
| 1 期末(2017年11月30日) | 円<br>10,078 | 円<br>0    | %<br>0.8  | 10,111                            | %<br>1.1  | %<br>95.4        | %<br>1.5       | 百万円<br>2,166 |

- (注1) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。
- (注2) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。
- (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注4) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
- (注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
- (注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。





## 運用経過

### 基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、設定時を10,000として指数化したものです。

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

#### ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：10,078円

騰落率：0.8%

#### ■基準価額の主な変動要因

主に日本を除く先進国国債に投資した結果、金利の動きは国によりまちまちだったものの、利息収入がプラスに寄与し、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。

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

| 年<br>月<br>日       | 基 準 価 額     |        | シティ世界国債インデックス<br>(除く日本、円ヘッジ・円ベース) |        | 公 社 債<br>組 入 比 率 | 債 券 先 物<br>比 率 |
|-------------------|-------------|--------|-----------------------------------|--------|------------------|----------------|
|                   |             | 騰 落 率  | (ベンチマーク)                          | 騰 落 率  |                  |                |
| (設定) 2017年 1 月11日 | 円<br>10,000 | %<br>－ | (1 / 10)<br>10,000                | %<br>－ | %<br>－           | %<br>－         |
| 1 月末              | 9,914       | △0.9   | 9,917                             | △0.8   | 91.7             | 6.9            |
| 2 月末              | 10,011      | 0.1    | 10,019                            | 0.2    | 94.9             | 3.9            |
| 3 月末              | 9,985       | △0.2   | 9,998                             | △0.0   | 95.0             | 8.2            |
| 4 月末              | 10,037      | 0.4    | 10,051                            | 0.5    | 96.3             | 3.2            |
| 5 月末              | 10,087      | 0.9    | 10,104                            | 1.0    | 96.2             | 3.8            |
| 6 月末              | 10,045      | 0.5    | 10,065                            | 0.7    | 97.9             | 1.0            |
| 7 月末              | 10,034      | 0.3    | 10,057                            | 0.6    | 95.3             | 0.9            |
| 8 月末              | 10,122      | 1.2    | 10,148                            | 1.5    | 98.4             | －              |
| 9 月末              | 10,033      | 0.3    | 10,060                            | 0.6    | 97.7             | 1.7            |
| 10月末              | 10,068      | 0.7    | 10,100                            | 1.0    | 93.2             | 3.4            |
| (期末) 2017年11月30日  | 10,078      | 0.8    | 10,111                            | 1.1    | 95.4             | 1.5            |

(注) 騰落率は設定比。

## 投資環境について

(2017.1.11～2017.11.30)

### ■外国債券市況

主要国の国債金利は、設定時より、上下に振れながらもおおむねレンジ内で推移しましたが、2017年3月中旬以降は、米国トランプ政権の政策に対する不透明感などから金利は低下基調となりました。6月下旬以降は、ECB（欧州中央銀行）やBOC（カナダ銀行）などが金融緩和姿勢を後退させる中で、ドイツやカナダなどを中心に金利が上昇しました。しかしその後、米国の政治動向の不透明感や地政学リスクの高まりなどから、金利は低下基調で推移しました。9月には、米国の2017年中の追加利上げ観測の高まりなどを背景に金利は上昇しましたが、その後は、金利はレンジ内での推移が続きまし

## ポートフォリオについて

(2017.1.11～2017.11.30)

### ■当ファンド

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

### ■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

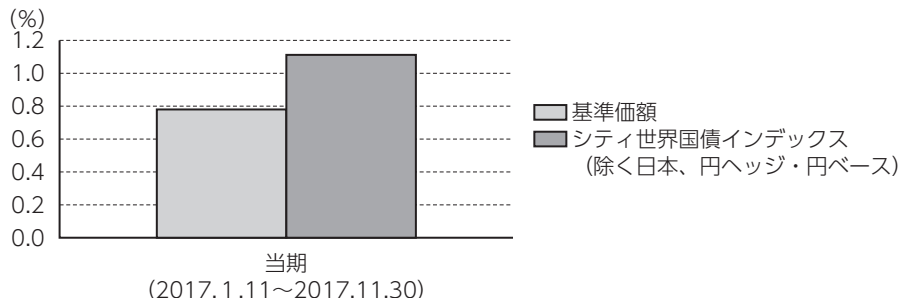
外貨建て資産については為替ヘッジを行ない、またファンドとベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース））の金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

## ベンチマークとの差異について

当期のベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース））の騰落率は1.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.8%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。

当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0.06%程度でした。



分配金について

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

分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項 目        |     | 当 期                        |
|------------|-----|----------------------------|
|            |     | 2017年1月11日<br>～2017年11月30日 |
| 当期分配金（税込み） | (円) | —                          |
| 対基準価額比率    | (%) | —                          |
| 当期の収益      | (円) | —                          |
| 当期の収益以外    | (円) | —                          |
| 翌期繰越分配対象額  | (円) | 77                         |

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



今後の運用方針

当ファンド

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

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

# 1万口当りの費用の明細

| 項 目       | 当期<br>(2017.1.11～2017.11.30) |         | 項 目 の 概 要                                                         |
|-----------|------------------------------|---------|-------------------------------------------------------------------|
|           | 金 額                          | 比 率     |                                                                   |
| 信 託 報 酬   | 23円                          | 0.230%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は10,036円です。                      |
| (投 信 会 社) | (16)                         | (0.163) | 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、目<br>論見書・運用報告書の作成等の対価        |
| (販 売 会 社) | (5)                          | (0.048) | 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<br>の情報提供等の対価               |
| (受 託 銀 行) | (2)                          | (0.019) | 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   | 0                            | 0.002   | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (先 物)     | (0)                          | (0.002) |                                                                   |
| 有価証券取引税   | —                            | —       | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| そ の 他 費 用 | 2                            | 0.024   | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数                                         |
| (保 管 費 用) | (2)                          | (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・<br>資産の移転等に要する費用            |
| (監 査 費 用) | (1)                          | (0.007) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                       |
| (そ の 他)   | (0)                          | (0.001) | 信託事務の処理等に関するその他の費用                                                |
| 合 計       | 26                           | 0.257   |                                                                   |

(注1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況  
親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

|                            | 設 定       |           | 解 約   |       |
|----------------------------|-----------|-----------|-------|-------|
|                            | □ 数       | 金 額       | □ 数   | 金 額   |
|                            | 千□        | 千円        | 千□    | 千円    |
| 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド | 2,240,522 | 2,159,819 | 5,837 | 5,636 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

| 設定時保有額 | 期中設定額 | 期中解約額 | 期末保有額 | 取 引 の 理 由        |
|--------|-------|-------|-------|------------------|
| 百万円    | 百万円   | 百万円   | 百万円   |                  |
| 1      | －     | 1     | －     | 当初設定時における取得とその処分 |

(注1) 金額は元本ベース。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

| 種 類                        | 当 期 末     |           |
|----------------------------|-----------|-----------|
|                            | □ 数       | 評 価 額     |
|                            | 千□        | 千円        |
| 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド | 2,234,684 | 2,164,068 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017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（為替ヘッジあり）マザーファンド | 2,164,068 | 99.8  |
| コール・ローン等、その他               | 5,223     | 0.2   |
| 投資信託財産総額                   | 2,169,292 | 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＝112.05円、1 カナダ・ドル＝87.10円、1 オーストラリア・ドル＝84.87円、1 シンガポール・ドル＝83.19円、1 イギリス・ポンド＝150.33円、1 スイス・フラン＝113.83円、1 デンマーク・クローネ＝17.84円、1 ノルウェー・クローネ＝13.58円、1 スウェーデン・クローネ＝13.38円、1 メキシコ・ペソ＝6.03円、1 マレーシア・リンギット＝27.42円、1 南アフリカ・ランド＝8.20円、1 ポーランド・ズロチ＝31.60円、1 ユーロ＝132.81円です。

(注3) 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（45,900,910千円）の投資信託財産総額（47,447,141千円）に対する比率は、96.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

| 項 目                             | 当 期 末          |
|---------------------------------|----------------|
| (A) 資産                          | 2,169,292,078円 |
| コール・ローン等                        | 5,223,329      |
| 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド(評価額) | 2,164,068,749  |
| (B) 負債                          | 3,101,910      |
| 未払解約金                           | 1,347,650      |
| 未払信託報酬                          | 1,701,167      |
| その他未払費用                         | 53,093         |
| (C) 純資産総額(A－B)                  | 2,166,190,168  |
| 元本                              | 2,149,445,185  |
| 次期繰越損益金                         | 16,744,983     |
| (D) 受益権総口数                      | 2,149,445,185口 |
| 1万口当り基準価額(C／D)                  | 10,078円        |

\* 設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は2,296,791,192円、同解約元本額は148,346,007円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,078円です。

■損益の状況

当期 自2017年1月11日 至2017年11月30日

| 項 目                  | 当 期          |
|----------------------|--------------|
| (A) 配当等収益            | △ 1,162円     |
| 受取利息                 | 38           |
| 支払利息                 | △ 1,200      |
| (B) 有価証券売買損益         | 9,353,226    |
| 売買益                  | 9,909,186    |
| 売買損                  | △ 555,960    |
| (C) 信託報酬等            | △ 2,340,771  |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 7,011,293    |
| (E) 追加信託差損益金         | 9,733,690    |
| (配当等相当額)             | (△ 732)      |
| (売買損益相当額)            | ( 9,734,422) |
| (F) 合計(D + E)        | 16,744,983   |
| 次期繰越損益金(F)           | 16,744,983   |
| 追加信託差損益金             | 9,733,690    |
| (配当等相当額)             | (△ 732)      |
| (売買損益相当額)            | ( 9,734,422) |
| 分配準備積立金              | 7,012,455    |
| 繰越損益金                | △ 1,162      |

(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「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■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        | 7,012,455      |
| (c) 収益調整金                  | 9,734,422      |
| (d) 分配準備積立金                | 0              |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 16,746,877     |
| (f) 分配金                    | 0              |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f)       | 16,746,877     |
| (h) 受益権総口数                 | 2,149,445,185口 |



<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の決算日（2017年6月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017年11月30日）現在における外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの組入資産の内容等を171～180ページに併せて掲載いたしました。

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの主要な売買銘柄  
公 社 債

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

| 買                                                         |   | 付         |   | 売                                                        |   | 付       |   |
|-----------------------------------------------------------|---|-----------|---|----------------------------------------------------------|---|---------|---|
| 銘                                                         | 柄 | 金         | 額 | 銘                                                        | 柄 | 金       | 額 |
|                                                           |   | 千円        |   |                                                          |   | 千円      |   |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2018/12/31   |   | 1,282,902 |   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2018/4/30  |   | 644,679 |   |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1% 2019/11/15     |   | 1,057,072 |   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.5% 2018/2/15   |   | 449,252 |   |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2020/11/15 |   | 835,035   |   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1% 2019/11/15    |   | 234,971 |   |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.875% 2020/6/30  |   | 820,901   |   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア) 4.5% 2018/8/1   |   | 207,619 |   |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/2/28   |   | 792,663   |   | FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4.25% 2018/10/25           |   | 135,148 |   |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/9/30   |   | 792,536   |   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2018/10/31 |   | 132,274 |   |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2024/5/15    |   | 747,341   |   | GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 0.25% 2018/4/13             |   | 128,885 |   |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2021/11/15     |   | 732,820   |   | United Kingdom Gilt (イギリス) 1.25% 2018/7/22               |   | 108,135 |   |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2019/12/31 |   | 728,940   |   | SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン) 0.25% 2018/4/30           |   | 101,645 |   |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2018/4/30   |   | 648,619   |   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2021/11/15    |   | 89,320  |   |

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

■組入資産明細表

下記は、2017年11月30日現在における外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（48,910,853千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

| 区 分     | 2017年11月30日現在         |                       |                  |           |                     |                   |           |          |
|---------|-----------------------|-----------------------|------------------|-----------|---------------------|-------------------|-----------|----------|
|         | 額 面 金 額               | 評 価 額                 |                  | 組 入 比 率   | う ち B B 格<br>以下組入比率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 |           |          |
|         |                       | 外 貨 建 金 額             | 邦 貨 換 算 金 額      |           |                     | 5 年 以 上           | 2 年 以 上   | 2 年 未 満  |
| アメリカ    | 千アメリカ・ドル<br>173,263   | 千アメリカ・ドル<br>175,806   | 千円<br>19,699,131 | %<br>41.6 | %<br>—              | %<br>16.4         | %<br>16.2 | %<br>8.9 |
| カナダ     | 千カナダ・ドル<br>10,254     | 千カナダ・ドル<br>11,064     | 963,737          | 2.0       | —                   | 0.9               | 0.8       | 0.4      |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル<br>10,407 | 千オーストラリア・ドル<br>11,267 | 956,232          | 2.0       | —                   | 1.3               | 0.6       | 0.2      |
| シンガポール  | 千シンガポール・ドル<br>1,967   | 千シンガポール・ドル<br>2,051   | 170,640          | 0.4       | —                   | 0.2               | 0.1       | 0.1      |
| イギリス    | 千イギリス・ポンド<br>16,307   | 千イギリス・ポンド<br>20,679   | 3,108,728        | 6.6       | —                   | 4.8               | 1.4       | 0.4      |
| スイス     | 千スイス・フラン<br>352       | 千スイス・フラン<br>409       | 46,660           | 0.1       | —                   | 0.0               | 0.1       | —        |
| デンマーク   | 千デンマーク・クローネ<br>13,440 | 千デンマーク・クローネ<br>16,606 | 296,256          | 0.6       | —                   | 0.4               | 0.1       | 0.1      |
| ノルウェー   | 千ノルウェー・クローネ<br>6,920  | 千ノルウェー・クローネ<br>7,327  | 99,506           | 0.2       | —                   | 0.1               | 0.0       | 0.0      |

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

| 区 分             | 2017年11月30日現在          |                        |               |          |                     |                   |          |         |
|-----------------|------------------------|------------------------|---------------|----------|---------------------|-------------------|----------|---------|
|                 | 額 面 金 額                | 評 価 額                  |               | 組 入 比 率  | う ち B B 格<br>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 |
| スウェーデン          | 千スウェーデン・クローネ<br>11,300 | 千スウェーデン・クローネ<br>12,935 | 千円<br>173,080 | %<br>0.4 | %<br>－              | %<br>0.2          | %<br>0.2 | %<br>－  |
| メキシコ            | 千メキシコ・ペソ<br>60,030     | 千メキシコ・ペソ<br>61,885     | 373,170       | 0.8      | －                   | 0.5               | 0.3      | 0.0     |
| マレーシア           | 千マレーシア・リンギット<br>5,830  | 千マレーシア・リンギット<br>5,747  | 157,584       | 0.3      | －                   | 0.2               | 0.1      | －       |
| 南アフリカ           | 千南アフリカ・ランド<br>28,430   | 千南アフリカ・ランド<br>25,220   | 206,811       | 0.4      | －                   | 0.4               | 0.0      | －       |
| ポーランド           | 千ポーランド・ズロチ<br>7,925    | 千ポーランド・ズロチ<br>8,140    | 257,237       | 0.5      | －                   | 0.2               | 0.3      | 0.1     |
| ユーロ<br>(アイルランド) | 千ユーロ<br>2,358          | 千ユーロ<br>2,718          | 361,072       | 0.8      | －                   | 0.5               | 0.1      | 0.1     |
| ユーロ<br>(オランダ)   | 千ユーロ<br>6,362          | 千ユーロ<br>7,584          | 1,007,234     | 2.1      | －                   | 1.5               | 0.4      | 0.2     |
| ユーロ<br>(ベルギー)   | 千ユーロ<br>7,650          | 千ユーロ<br>8,739          | 1,160,631     | 2.5      | －                   | 1.6               | 0.6      | 0.2     |
| ユーロ<br>(フランス)   | 千ユーロ<br>29,225         | 千ユーロ<br>35,402         | 4,701,846     | 9.9      | －                   | 6.3               | 2.4      | 1.2     |
| ユーロ<br>(ドイツ)    | 千ユーロ<br>20,974         | 千ユーロ<br>24,815         | 3,295,775     | 7.0      | －                   | 4.1               | 1.8      | 1.1     |
| ユーロ<br>(スペイン)   | 千ユーロ<br>17,520         | 千ユーロ<br>19,994         | 2,655,413     | 5.6      | －                   | 3.5               | 1.4      | 0.7     |
| ユーロ<br>(イタリア)   | 千ユーロ<br>28,279         | 千ユーロ<br>34,333         | 4,559,831     | 9.6      | －                   | 5.7               | 2.9      | 1.1     |
| ユーロ<br>(フィンランド) | 千ユーロ<br>1,870          | 千ユーロ<br>2,058          | 273,395       | 0.6      | －                   | 0.4               | 0.2      | 0.0     |
| ユーロ<br>(オーストリア) | 千ユーロ<br>4,510          | 千ユーロ<br>5,321          | 706,747       | 1.5      | －                   | 1.0               | 0.4      | 0.1     |
| ユーロ<br>(小計)     | 118,748                | 140,967                | 18,721,947    | 39.5     | －                   | 24.6              | 10.2     | 4.7     |
| 合 計             | －                      | －                      | 45,230,726    | 95.5     | －                   | 50.2              | 30.4     | 14.8    |

(注1) 邦貨換算金額は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国（外貨建）公社債（銘柄別）

| 2017年11月30日現在 |                                  |         |             |                    |                    |                 |            |  |
|---------------|----------------------------------|---------|-------------|--------------------|--------------------|-----------------|------------|--|
| 区 分           | 銘 柄                              | 種 類     | 年 利 率       | 額 面 金 額            | 評 価 額              |                 | 償 還 年 月 日  |  |
|               |                                  |         |             |                    | 外 貨 建 金 額          | 邦 貨 換 算 金 額     |            |  |
| アメリカ          | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | %<br>2.6250 | 千アメリカ・ドル<br>12,370 | 千アメリカ・ドル<br>12,641 | 千円<br>1,416,427 | 2020/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 3.6250      | 4,540              | 4,782              | 535,927         | 2021/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.0000      | 10,246             | 10,254             | 1,149,040       | 2021/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.6250      | 4,700              | 4,598              | 515,296         | 2022/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.1250      | 7,950              | 7,844              | 879,030         | 2019/12/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.7500      | 2,200              | 2,155              | 241,481         | 2023/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 1.8750      | 7,540              | 7,550              | 846,006         | 2020/06/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond | 国 債 証 券 | 2.5000      | 3,310              | 3,368              | 377,461         | 2023/08/15 |  |

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

| 2017年11月30日現在 |                                      |         |        |          |           |             |            |  |
|---------------|--------------------------------------|---------|--------|----------|-----------|-------------|------------|--|
| 区 分           | 銘 柄                                  | 種 類     | 年 利 率  | 額 面 金 額  | 評 価 額     |             | 償 還 年 月 日  |  |
|               |                                      |         |        |          | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |  |
|               |                                      |         | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円          |            |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.2500 | 4,745    | 4,728     | 529,805     | 2018/10/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.7500 | 5,905    | 6,091     | 682,590     | 2023/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.5000 | 14,160   | 14,134    | 1,583,772   | 2018/12/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.5000 | 7,580    | 7,697     | 862,469     | 2024/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.1250 | 4,990    | 5,018     | 562,271     | 2021/06/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 6.1250 | 1,750    | 2,331     | 261,216     | 2027/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 5.3750 | 380      | 505       | 56,658      | 2031/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 4.5000 | 1,250    | 1,605     | 179,914     | 2036/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 3.5000 | 1,730    | 1,958     | 219,500     | 2039/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 4.3750 | 410      | 523       | 58,609      | 2039/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 4.6250 | 350      | 461       | 51,711      | 2040/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 4.7500 | 670      | 901       | 101,049     | 2041/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 3.1250 | 2,370    | 2,517     | 282,049     | 2042/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.8750 | 3,390    | 3,437     | 385,190     | 2043/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 3.6250 | 1,100    | 1,267     | 142,060     | 2043/08/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 3.7500 | 332      | 390       | 43,783      | 2043/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 3.3750 | 2,600    | 2,879     | 322,668     | 2044/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 3.1250 | 3,190    | 3,384     | 379,189     | 2044/08/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.5000 | 8,440    | 8,398     | 941,001     | 2019/10/31 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.2500 | 5,010    | 5,005     | 560,887     | 2024/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.7500 | 7,150    | 7,070     | 792,200     | 2022/02/28 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 3.0000 | 1,570    | 1,626     | 182,295     | 2045/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.0000 | 2,820    | 2,758     | 309,067     | 2025/08/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.7500 | 9,020    | 8,880     | 995,055     | 2022/09/30 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.2500 | 3,100    | 3,083     | 345,534     | 2025/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.6250 | 1,165    | 1,100     | 123,327     | 2026/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.5000 | 2,070    | 1,939     | 217,300     | 2046/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 0.8750 | 3,020    | 2,983     | 334,279     | 2019/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.5000 | 1,000    | 932       | 104,521     | 2026/08/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.0000 | 2,350    | 2,280     | 255,520     | 2026/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.8750 | 2,480    | 2,506     | 280,879     | 2046/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 1.0000 | 7,500    | 7,390     | 828,122     | 2019/11/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.2500 | 2,320    | 2,295     | 257,171     | 2027/02/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.3750 | 1,850    | 1,848     | 207,145     | 2027/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 3.0000 | 1,430    | 1,481     | 165,975     | 2047/05/15 |  |
|               | United States Treasury Note/Bond     | 国 債 証 券 | 2.7500 | 1,210    | 1,192     | 133,662     | 2047/08/15 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額                         | 44銘柄    |        | 173,263  | 175,806   | 19,699,131  |            |  |
| 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 | 260      | 301       | 26,280      | 2064/12/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 5.7500 | 357      | 495       | 43,136      | 2029/06/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 5.7500 | 250      | 370       | 32,301      | 2033/06/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 5.0000 | 418      | 604       | 52,650      | 2037/06/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 4.0000 | 170      | 224       | 19,553      | 2041/06/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 3.5000 | 2,520    | 2,645     | 230,429     | 2020/06/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 2.7500 | 400      | 420       | 36,585      | 2022/06/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 3.5000 | 680      | 856       | 74,564      | 2045/12/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 1.5000 | 718      | 711       | 61,976      | 2023/06/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 2.5000 | 230      | 240       | 20,982      | 2024/06/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 1.7500 | 2,110    | 2,121     | 184,762     | 2019/03/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 2.2500 | 292      | 301       | 26,275      | 2025/06/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 1.5000 | 320      | 311       | 27,155      | 2026/06/01 |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国 債 証 券 | 0.7500 | 759      | 737       | 64,195      | 2021/09/01 |  |

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

| 2017年11月30日現在 |                            |         |        |             |             |             |            |  |
|---------------|----------------------------|---------|--------|-------------|-------------|-------------|------------|--|
| 区 分           | 銘 柄                        | 種 類     | 年 利 率  | 額 面 金 額     | 評 価 額       |             | 償 還 年 月 日  |  |
|               |                            |         |        |             | 外 貨 建 金 額   | 邦 貨 換 算 金 額 |            |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | %      | 千カナダ・ドル     | 千カナダ・ドル     | 千円          |            |  |
|               | CANADIAN GOVERNMENT BOND   | 国 債 証 券 | 1.0000 | 430         | 397         | 34,597      | 2027/06/01 |  |
|               |                            |         | 0.5000 | 340         | 324         | 28,292      | 2022/03/01 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額               | 16銘柄    |        | 10,254      | 11,064      | 963,737     |            |  |
| オーストラリア       | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.2500 | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル |             |            |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.7500 | 550         | 574         | 48,799      | 2019/03/15 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.7500 | 1,120       | 1,262       | 107,183     | 2021/05/15 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.5000 | 800         | 850         | 72,159      | 2020/04/15 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.7500 | 630         | 732         | 62,152      | 2022/07/15 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.5000 | 683         | 799         | 67,841      | 2023/04/21 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.7500 | 689         | 822         | 69,822      | 2027/04/21 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.7500 | 656         | 675         | 57,359      | 2024/04/21 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 920         | 982         | 83,394      | 2029/04/21 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 650         | 690         | 58,617      | 2025/04/21 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.5000 | 299         | 364         | 30,937      | 2033/04/21 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.2500 | 668         | 762         | 64,681      | 2026/04/21 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.7500 | 300         | 305         | 25,945      | 2019/10/21 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.7500 | 325         | 363         | 30,813      | 2037/04/21 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.7500 | 400         | 398         | 33,830      | 2020/11/21 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 184         | 189         | 16,107      | 2039/06/21 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.2500 | 1,258       | 1,228       | 104,263     | 2028/05/21 |  |
|               | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.0000 | 275         | 263         | 22,320      | 2047/03/21 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額               | 17銘柄    |        | 10,407      | 11,267      | 956,232     |            |  |
| シンガポール        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国 債 証 券 | 3.5000 | 千シンガポール・ドル  | 千シンガポール・ドル  |             |            |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国 債 証 券 | 2.5000 | 203         | 226         | 18,858      | 2027/03/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国 債 証 券 | 3.0000 | 125         | 126         | 10,562      | 2019/06/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国 債 証 券 | 3.0000 | 150         | 159         | 13,308      | 2024/09/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国 債 証 券 | 2.8750 | 100         | 106         | 8,818       | 2030/09/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国 債 証 券 | 2.2500 | 390         | 398         | 33,115      | 2021/06/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国 債 証 券 | 2.7500 | 89          | 91          | 7,644       | 2042/04/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国 債 証 券 | 2.7500 | 200         | 209         | 17,439      | 2023/07/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国 債 証 券 | 3.3750 | 120         | 134         | 11,214      | 2033/09/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国 債 証 券 | 1.6250 | 300         | 300         | 25,024      | 2019/10/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国 債 証 券 | 2.3750 | 100         | 102         | 8,526       | 2025/06/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国 債 証 券 | 2.7500 | 130         | 135         | 11,270      | 2046/03/01 |  |
|               | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国 債 証 券 | 2.2500 | 60          | 58          | 4,857       | 2036/08/01 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額               | 12銘柄    |        | 1,967       | 2,051       | 170,640     |            |  |
| イギリス          | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 2.0000 | 千イギリス・ポンド   | 千イギリス・ポンド   |             |            |  |
|               | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 1.5000 | 750         | 797         | 119,851     | 2025/09/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 2.5000 | 400         | 410         | 61,736      | 2021/01/22 |  |
|               | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 2.5000 | 560         | 704         | 105,938     | 2065/07/22 |  |
|               | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 1.5000 | 525         | 535         | 80,545      | 2026/07/22 |  |
|               | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 0.5000 | 250         | 246         | 37,022      | 2022/07/22 |  |
|               | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 6.0000 | 583         | 856         | 128,799     | 2028/12/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 5.0000 | 275         | 350         | 52,623      | 2025/03/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,165       | 1,607       | 241,633     | 2036/03/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 4.7500 | 790         | 865         | 130,136     | 2020/03/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 4.2500 | 620         | 941         | 141,605     | 2046/12/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 4.5000 | 411         | 622         | 93,629      | 2042/12/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 4.7500 | 907         | 1,246       | 187,419     | 2030/12/07 |  |
|               | United Kingdom Gilt        | 国 債 証 券 | 4.2500 | 603         | 950         | 142,880     | 2049/12/07 |  |

外国債券インデックス（為替ヘッジあり） マザーファンド

| 2017年11月30日現在 |                           |      |         |       |              |              |             |            |
|---------------|---------------------------|------|---------|-------|--------------|--------------|-------------|------------|
| 区 分           | 銘                         | 柄    | 種 類     | 年 利 率 | 額 面 金 額      | 評 価 額        |             | 償 還 年 月 日  |
|               |                           |      |         |       |              | 外 貨 建 金 額    | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
|               | United Kingdom Gilt       |      | 国 債 証 券 | %     | 千イギリス・ポンド    | 千イギリス・ポンド    | 千円          |            |
|               |                           |      |         |       | 4.2500       | 980          | 1,392       | 2039/09/07 |
|               |                           |      |         |       | 4.0000       | 540          | 614         | 2022/03/07 |
|               |                           |      |         |       | 3.7500       | 1,045        | 1,105       | 2019/09/07 |
|               |                           |      |         |       | 4.0000       | 587          | 984         | 2060/01/22 |
|               |                           |      |         |       | 3.7500       | 810          | 881         | 2020/09/07 |
|               |                           |      |         |       | 3.7500       | 742          | 827         | 2021/09/07 |
|               |                           |      |         |       | 1.7500       | 580          | 605         | 2022/09/07 |
|               |                           |      |         |       | 3.2500       | 525          | 667         | 2044/01/22 |
|               |                           |      |         |       | 2.2500       | 840          | 901         | 2023/09/07 |
|               |                           |      |         |       | 3.5000       | 748          | 1,205       | 2068/07/22 |
|               |                           |      |         |       | 2.7500       | 300          | 333         | 2024/09/07 |
|               |                           |      |         |       | 3.5000       | 770          | 1,025       | 2045/01/22 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数                     | 25銘柄 |         |       | 16,307       | 20,679       | 3,108,728   |            |
| スイス           | SWISS GOVERNMENT BOND     |      | 国 債 証 券 |       | 千スイス・フラン     | 千スイス・フラン     |             |            |
|               |                           |      |         |       | 4.0000       | 82           | 116         | 2028/04/08 |
|               |                           |      |         |       | 2.2500       | 120          | 129         | 2020/07/06 |
|               | SWISS GOVERNMENT BOND     |      | 国 債 証 券 |       | 2.0000       | 150          | 163         | 2021/04/28 |
|               |                           |      |         |       |              |              |             |            |
|               |                           |      |         |       |              |              |             |            |
| 通貨小計          | 銘 柄 数                     | 3銘柄  |         |       | 352          | 409          | 46,660      |            |
| デンマーク         | DANISH GOVERNMENT BOND    |      | 国 債 証 券 |       | 千デンマーク・クローネ  | 千デンマーク・クローネ  |             |            |
|               |                           |      |         |       | 4.5000       | 3,140        | 5,327       | 2039/11/15 |
|               |                           |      |         |       | 4.0000       | 2,760        | 3,012       | 2019/11/15 |
|               |                           |      |         |       | 3.0000       | 2,310        | 2,620       | 2021/11/15 |
|               |                           |      |         |       | 1.5000       | 1,170        | 1,280       | 2023/11/15 |
|               |                           |      |         |       | 1.7500       | 2,330        | 2,624       | 2025/11/15 |
|               |                           |      |         |       | 0.2500       | 330          | 332         | 2018/11/15 |
|               |                           |      |         |       | 0.5000       | 1,400        | 1,407       | 2027/11/15 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数                     | 7銘柄  |         |       | 13,440       | 16,606       | 296,256     |            |
| ノルウェー         | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 |       | 千ノルウェー・クローネ  | 千ノルウェー・クローネ  |             |            |
|               |                           |      |         |       | 4.5000       | 1,270        | 1,344       | 2019/05/22 |
|               |                           |      |         |       | 3.7500       | 1,120        | 1,231       | 2021/05/25 |
|               |                           |      |         |       | 2.0000       | 1,150        | 1,204       | 2023/05/24 |
|               |                           |      |         |       | 3.0000       | 1,300        | 1,441       | 2024/03/14 |
|               |                           |      |         |       | 1.7500       | 150          | 154         | 2025/03/13 |
|               |                           |      |         |       | 1.5000       | 1,430        | 1,441       | 2026/02/19 |
|               |                           |      |         |       | 1.7500       | 500          | 510         | 2027/02/17 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数                     | 7銘柄  |         |       | 6,920        | 7,327        | 99,506      |            |
| スウェーデン        | SWEDISH GOVERNMENT BOND   |      | 国 債 証 券 |       | 千スウェーデン・クローネ | 千スウェーデン・クローネ |             |            |
|               |                           |      |         |       | 5.0000       | 2,780        | 3,244       | 2020/12/01 |
|               |                           |      |         |       | 3.5000       | 870          | 1,198       | 2039/03/30 |
|               |                           |      |         |       | 3.5000       | 2,950        | 3,447       | 2022/06/01 |
|               |                           |      |         |       | 1.5000       | 1,400        | 1,519       | 2023/11/13 |
|               |                           |      |         |       | 2.5000       | 1,020        | 1,187       | 2025/05/12 |
|               |                           |      |         |       | 1.0000       | 1,280        | 1,336       | 2026/11/12 |
|               |                           |      |         |       | 0.7500       | 1,000        | 1,001       | 2028/05/12 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数                     | 7銘柄  |         |       | 11,300       | 12,935       | 173,080     |            |
| メキシコ          | Mexican Bonos             |      | 国 債 証 券 |       | 千メキシコ・ペソ     | 千メキシコ・ペソ     |             |            |
|               |                           |      |         |       | 5.0000       | 5,400        | 5,191       | 2019/12/11 |
|               | Mexican Bonos             |      | 国 債 証 券 |       | 5.7500       | 4,200        | 3,823       | 2026/03/05 |

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

| 2017年11月30日現在 |                          |         |         |              |              |             |            |  |
|---------------|--------------------------|---------|---------|--------------|--------------|-------------|------------|--|
| 区 分           | 銘 柄                      | 種 類     | 年 利 率   | 額 面 金 額      | 評 価 額        |             | 償 還 年 月 日  |  |
|               |                          |         |         |              | 外 貨 建 金 額    | 邦 貨 換 算 金 額 |            |  |
|               |                          |         | %       | 千メキシコ・ペソ     | 千メキシコ・ペソ     | 千円          |            |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 8.0000  | 1,450        | 1,524        | 9,190       | 2047/11/07 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 8.0000  | 2,740        | 2,856        | 17,223      | 2023/12/07 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 10.0000 | 6,340        | 7,338        | 44,249      | 2024/12/05 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 7.5000  | 2,800        | 2,846        | 17,166      | 2027/06/03 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 10.0000 | 2,750        | 3,440        | 20,746      | 2036/11/20 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 8.5000  | 2,500        | 2,729        | 16,457      | 2029/05/31 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 8.5000  | 2,000        | 2,026        | 12,216      | 2018/12/13 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 8.5000  | 1,000        | 1,102        | 6,645       | 2038/11/18 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 8.0000  | 5,500        | 5,620        | 33,892      | 2020/06/11 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 6.5000  | 8,700        | 8,539        | 51,492      | 2021/06/10 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 7.7500  | 2,700        | 2,787        | 16,809      | 2031/05/29 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 6.5000  | 3,900        | 3,808        | 22,964      | 2022/06/09 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 7.7500  | 4,750        | 4,856        | 29,284      | 2042/11/13 |  |
|               | Mexican Bonos            | 国 債 証 券 | 7.7500  | 3,300        | 3,394        | 20,467      | 2034/11/23 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額             | 16銘柄    |         | 60,030       | 61,885       | 373,170     |            |  |
| マレーシア         |                          |         |         | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット |             |            |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 4.4980  | 260          | 259          | 7,106       | 2030/04/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.8920  | 1,250        | 1,216        | 33,367      | 2027/03/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.4920  | 1,050        | 1,056        | 28,970      | 2020/03/31 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.8440  | 600          | 558          | 15,315      | 2033/04/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.9550  | 150          | 148          | 4,071       | 2025/09/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.7950  | 1,100        | 1,099        | 30,154      | 2022/09/30 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.8000  | 600          | 596          | 16,348      | 2023/08/17 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 4.7360  | 420          | 411          | 11,271      | 2046/03/15 |  |
|               | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国 債 証 券 | 3.6200  | 400          | 400          | 10,980      | 2021/11/30 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額             | 9銘柄     |         | 5,830        | 5,747        | 157,584     |            |  |
| 南アフリカ         |                          |         |         | 千南アフリカ・ランド   | 千南アフリカ・ランド   |             |            |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 7.2500  | 1,210        | 1,192        | 9,775       | 2020/01/15 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 10.5000 | 3,510        | 3,763        | 30,862      | 2026/12/21 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 6.7500  | 1,200        | 1,146        | 9,405       | 2021/03/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 6.5000  | 2,610        | 1,760        | 14,439      | 2041/02/28 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 7.7500  | 1,400        | 1,349        | 11,067      | 2023/02/28 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.7500  | 3,400        | 2,920        | 23,944      | 2048/02/28 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.5000  | 5,250        | 4,515        | 37,029      | 2037/01/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.0000  | 2,850        | 2,496        | 20,474      | 2030/01/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.7500  | 2,300        | 1,974        | 16,187      | 2044/01/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.2500  | 4,700        | 4,100        | 33,623      | 2032/03/31 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額             | 10銘柄    |         | 28,430       | 25,220       | 206,811     |            |  |
| ポーランド         |                          |         |         | 千ポーランド・ズロチ   | 千ポーランド・ズロチ   |             |            |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 5.7500  | 1,200        | 1,371        | 43,327      | 2022/09/23 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 5.5000  | 1,120        | 1,202        | 38,007      | 2019/10/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 1.5000  | 1,340        | 1,331        | 42,072      | 2020/04/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 2.5000  | 640          | 604          | 19,116      | 2026/07/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 1.7500  | 1,520        | 1,494        | 47,220      | 2021/07/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 2.5000  | 815          | 759          | 24,013      | 2027/07/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 5.7500  | 150          | 187          | 5,926       | 2029/04/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 4.0000  | 710          | 755          | 23,873      | 2023/10/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 3.2500  | 430          | 432          | 13,679      | 2025/07/25 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額             | 9銘柄     |         | 7,925        | 8,140        | 257,237     |            |  |

外国債券インデックス（為替ヘッジあり） マザーファンド

| 2017年11月30日現在 |                             |      |         |        |               |               |              |            |
|---------------|-----------------------------|------|---------|--------|---------------|---------------|--------------|------------|
| 区 分           | 銘                           | 柄    | 種 類     | 年 利 率  | 額 面 金 額       | 評 価 額         |              | 償 還 年 月 日  |
|               |                             |      |         |        |               | 外 貨 建 金 額     | 邦 貨 換 算 金 額  |            |
| ユーロ（アイルランド）   | IRISH TREASURY              |      | 国 債 証 券 | 4.4000 | 千ユーロ<br>290   | 千ユーロ<br>312   | 千円<br>41,509 | 2019/06/18 |
|               | IRISH TREASURY              |      | 国 債 証 券 | 5.4000 | 288           | 391           | 51,928       | 2025/03/13 |
|               | IRISH TREASURY              |      | 国 債 証 券 | 5.0000 | 260           | 301           | 40,088       | 2020/10/18 |
|               | IRISH TREASURY              |      | 国 債 証 券 | 3.9000 | 420           | 506           | 67,266       | 2023/03/20 |
|               | IRISH TREASURY              |      | 国 債 証 券 | 3.4000 | 100           | 119           | 15,935       | 2024/03/18 |
|               | IRISH TREASURY              |      | 国 債 証 券 | 2.4000 | 280           | 323           | 42,955       | 2030/05/15 |
|               | IRISH TREASURY              |      | 国 債 証 券 | 2.0000 | 160           | 168           | 22,373       | 2045/02/18 |
|               | IRISH TREASURY              |      | 国 債 証 券 | 1.0000 | 320           | 330           | 43,877       | 2026/05/15 |
|               | IRISH TREASURY              |      | 国 債 証 券 | 1.7000 | 50            | 51            | 6,848        | 2037/05/15 |
|               | IRISH TREASURY              |      | 国 債 証 券 | 4.5000 | 190           | 212           | 28,288       | 2020/04/18 |
| 国 小 計         | 銘 柄 数<br>金 額                | 10銘柄 |         |        | 2,358         | 2,718         | 361,072      |            |
| ユーロ（オランダ）     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 5.5000 | 千ユーロ<br>580   | 千ユーロ<br>869   | 115,416      | 2028/01/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 4.0000 | 355           | 545           | 72,479       | 2037/01/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 3.7500 | 900           | 1,084         | 144,031      | 2023/01/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 4.0000 | 200           | 215           | 28,607       | 2019/07/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 3.5000 | 175           | 194           | 25,770       | 2020/07/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 3.7500 | 330           | 516           | 68,636       | 2042/01/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 3.2500 | 492           | 559           | 74,251       | 2021/07/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 2.5000 | 270           | 334           | 44,386       | 2033/01/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 1.2500 | 550           | 562           | 74,687       | 2019/01/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 2.7500 | 320           | 439           | 58,425       | 2047/01/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 2.0000 | 380           | 430           | 57,110       | 2024/07/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 0.2500 | 350           | 356           | 47,367       | 2020/01/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 0.2500 | 290           | 291           | 38,699       | 2025/07/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 0.5000 | 370           | 375           | 49,847       | 2026/07/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | －      | 300           | 304           | 40,440       | 2022/01/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | 0.7500 | 200           | 204           | 27,205       | 2027/07/15 |
|               | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND |      | 国 債 証 券 | －      | 300           | 300           | 39,871       | 2024/01/15 |
| 国 小 計         | 銘 柄 数<br>金 額                | 17銘柄 |         |        | 6,362         | 7,584         | 1,007,234    |            |
| ユーロ（ベルギー）     | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 0.8000 | 千ユーロ<br>350   | 千ユーロ<br>363   | 48,288       | 2025/06/22 |
|               | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 1.0000 | 972           | 975           | 129,576      | 2031/06/22 |
|               | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 1.9000 | 260           | 286           | 38,052       | 2038/06/22 |
|               | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 1.0000 | 595           | 623           | 82,786       | 2026/06/22 |
|               | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 1.6000 | 564           | 559           | 74,328       | 2047/06/22 |
|               | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 0.8000 | 580           | 590           | 78,461       | 2027/06/22 |
|               | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 5.0000 | 200           | 322           | 42,897       | 2035/03/28 |
|               | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 4.0000 | 550           | 654           | 86,866       | 2022/03/28 |
|               | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 3.7500 | 534           | 599           | 79,589       | 2020/09/28 |
|               | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 4.2500 | 515           | 811           | 107,709      | 2041/03/28 |
|               | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 4.2500 | 730           | 889           | 118,120      | 2022/09/28 |
|               | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 3.0000 | 700           | 746           | 99,111       | 2019/09/28 |
|               | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 2.6000 | 800           | 931           | 123,706      | 2024/06/22 |
|               | Belgium Government Bond     |      | 国 債 証 券 | 3.0000 | 300           | 385           | 51,135       | 2034/06/22 |
| 国 小 計         | 銘 柄 数<br>金 額                | 14銘柄 |         |        | 7,650         | 8,739         | 1,160,631    |            |
| ユーロ（フランス）     | FRENCH GOVERNMENT BOND      |      | 国 債 証 券 | 6.0000 | 千ユーロ<br>1,485 | 千ユーロ<br>2,162 | 287,166      | 2025/10/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      |      | 国 債 証 券 | 5.7500 | 650           | 1,078         | 143,276      | 2032/10/25 |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND      |      | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,130         | 1,774         | 235,700      | 2035/04/25 |



外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

| 2017年11月30日現在 |                        |         |        |         |           |             |            |  |
|---------------|------------------------|---------|--------|---------|-----------|-------------|------------|--|
| 区 分           | 銘 柄                    | 種 類     | 年 利 率  | 額 面 金 額 | 評 価 額     |             | 償 還 年 月 日  |  |
|               |                        |         |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |  |
|               |                        |         | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |            |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.0000 | 1,082   | 1,749     | 232,370     | 2055/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.7500 | 650     | 743       | 98,732      | 2021/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.0000 | 715     | 1,067     | 141,788     | 2038/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.2500 | 1,000   | 1,255     | 166,756     | 2023/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.5000 | 743     | 1,203     | 159,778     | 2041/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.7500 | 860     | 932       | 123,889     | 2019/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.5000 | 500     | 549       | 72,941      | 2020/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.5000 | 1,040   | 1,314     | 174,626     | 2026/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.5000 | 2,770   | 3,013     | 400,228     | 2020/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 1,514   | 1,729     | 229,655     | 2021/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.0000 | 1,300   | 1,488     | 197,749     | 2022/04/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.7500 | 1,110   | 1,341     | 178,108     | 2027/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.2500 | 995     | 1,114     | 147,977     | 2022/10/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 590     | 810       | 107,675     | 2045/05/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.7500 | 1,030   | 1,134     | 150,662     | 2023/05/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.2500 | 1,400   | 1,599     | 212,455     | 2024/05/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.0000 | 1,475   | 1,511     | 200,801     | 2019/05/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.5000 | 2,486   | 2,963     | 393,640     | 2030/05/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.7500 | 1,060   | 1,178     | 156,531     | 2024/11/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.5000 | 1,690   | 1,728     | 229,528     | 2019/11/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.5000 | 600     | 605       | 80,466      | 2026/05/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.2500 | 1,050   | 1,030     | 136,814     | 2026/11/25 |  |
|               | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.7500 | 300     | 320       | 42,523      | 2039/06/25 |  |
| 国 小 計         | 銘 柄 数 額                | 26銘柄    |        | 29,225  | 35,402    | 4,701,846   |            |  |
| ユーロ（ドイツ）      |                        |         |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |             |            |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 6.5000 | 855     | 1,354     | 179,842     | 2027/07/04 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 6.2500 | 1,146   | 1,911     | 253,873     | 2030/01/04 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 5.5000 | 160     | 258       | 34,284      | 2031/01/04 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.7500 | 290     | 468       | 62,162      | 2034/07/04 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.0000 | 740     | 1,140     | 151,467     | 2037/01/04 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.2500 | 220     | 360       | 47,860      | 2039/07/04 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 4.7500 | 360     | 633       | 84,175      | 2040/07/04 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,010   | 1,060     | 140,840     | 2019/01/04 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.5000 | 1,334   | 1,425     | 189,270     | 2019/07/04 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 3.2500 | 306     | 450       | 59,815      | 2042/07/04 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.2500 | 2,055   | 2,269     | 301,355     | 2021/09/04 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.7500 | 1,542   | 1,693     | 224,848     | 2022/07/04 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.5000 | 648     | 852       | 113,166     | 2044/07/04 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.5000 | 900     | 982       | 130,551     | 2023/02/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.0000 | 960     | 1,079     | 143,423     | 2023/08/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.7500 | 500     | 557       | 74,086      | 2024/02/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 2.5000 | 575     | 762       | 101,333     | 2046/08/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 1.5000 | 470     | 517       | 68,775      | 2024/05/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.5000 | 1,190   | 1,230     | 163,376     | 2025/02/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.5000 | 883     | 907       | 120,572     | 2026/02/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | —      | 750     | 735       | 97,622      | 2026/08/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.5000 | 300     | 303       | 40,264      | 2027/08/15 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.2500 | 1,440   | 1,466     | 194,734     | 2019/10/11 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | —      | 400     | 406       | 53,963      | 2020/04/17 |  |
|               | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券 | 0.2500 | 1,940   | 1,988     | 264,108     | 2020/10/16 |  |
| 国 小 計         | 銘 柄 数 額                | 25銘柄    |        | 20,974  | 24,815    | 3,295,775   |            |  |

外国債券インデックス（為替ヘッジあり） マザーファンド

| 2017年11月30日現在           |                                   |         |        |       |         |            |             |           |
|-------------------------|-----------------------------------|---------|--------|-------|---------|------------|-------------|-----------|
| 区 分                     |                                   | 銘 柄     | 種 類    | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額      |             | 償 還 年 月 日 |
|                         |                                   |         |        |       |         | 外 貨 建 金 額  | 邦 貨 換 算 金 額 |           |
| ユーロ（スペイン）               |                                   |         |        | %     | 千ユーロ    | 千ユーロ       | 千円          |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 6.0000 | 900   | 1,300   | 172,719    | 2029/01/31  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 1.9500 | 610   | 617     | 81,968     | 2030/07/30  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 2.1500 | 1,445 | 1,560   | 207,242    | 2025/10/31  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 0.2500 | 1,000 | 1,007   | 133,758    | 2019/01/31  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 0.7500 | 500   | 513     | 68,163     | 2021/07/30  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 2.9000 | 669   | 689     | 91,510     | 2046/10/31  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 1.3000 | 1,349 | 1,352   | 179,594    | 2026/10/31  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 2.3500 | 300   | 307     | 40,895     | 2033/07/30  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 1.4500 | 670   | 667     | 88,665     | 2027/10/31  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 5.7500 | 280   | 415     | 55,142     | 2032/07/30  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 4.2000 | 550   | 712     | 94,647     | 2037/01/31  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 4.6000 | 1,238 | 1,339   | 177,938    | 2019/07/30  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 4.7000 | 743   | 1,031   | 137,042    | 2041/07/30  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 4.8500 | 600   | 686     | 91,192     | 2020/10/31  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 5.5000 | 724   | 859     | 114,194    | 2021/04/30  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 5.8500 | 1,140 | 1,410   | 187,342    | 2022/01/31  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 5.4000 | 810   | 1,015   | 134,917    | 2023/01/31  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 4.4000 | 988   | 1,206   | 160,211    | 2023/10/31  |           |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 5.1500 | 140   | 206     | 27,367     | 2044/10/31  |           |
| SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券                           | 2.7500  | 1,384  | 1,561 | 207,399 | 2024/10/31 |             |           |
| SPANISH GOVERNMENT BOND | 国 債 証 券                           | 1.4000  | 1,480  | 1,532 | 203,499 | 2020/01/31 |             |           |
| 国 小 計                   | 銘 柄 数<br>金 額                      | 21銘柄    |        |       | 17,520  | 19,994     | 2,655,413   |           |
| ユーロ（イタリア）               |                                   |         |        |       | 千ユーロ    | 千ユーロ       |             |           |
|                         | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 7.2500 | 800   | 1,177   | 156,332    | 2026/11/01  |           |
|                         | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 6.5000 | 1,635 | 2,341   | 310,935    | 2027/11/01  |           |
|                         | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 3.2500 | 705   | 750     | 99,732     | 2046/09/01  |           |
|                         | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 1.5000 | 820   | 828     | 110,062    | 2025/06/01  |           |
|                         | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 0.6500 | 200   | 197     | 26,208     | 2023/10/15  |           |
|                         | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国 債 証 券 | 2.8000 | 290   | 262     | 34,844     | 2067/03/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.2500 | 340   | 456     | 60,618     | 2029/11/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 6.0000 | 1,288 | 1,862   | 247,358    | 2031/05/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.7500 | 550   | 789     | 104,856    | 2033/02/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.0000 | 1,050 | 1,420   | 188,661    | 2034/08/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.0000 | 770   | 937     | 124,507    | 2037/02/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 3.7500 | 702   | 793     | 105,319    | 2021/08/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.0000 | 470   | 645     | 85,705     | 2039/08/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,570 | 1,914   | 254,330    | 2023/08/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.2500 | 3,470 | 3,748   | 497,847    | 2019/09/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.0000 | 664   | 904     | 120,185    | 2040/09/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.0000 | 2,550 | 2,835   | 376,528    | 2020/09/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.5000 | 1,850 | 2,281   | 302,948    | 2026/03/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 3.7500 | 650   | 727     | 96,597     | 2021/03/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,320 | 1,543   | 205,018    | 2021/09/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.0000 | 780   | 932     | 123,799    | 2022/03/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 5.5000 | 2,270 | 2,811   | 373,363    | 2022/11/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.7500 | 130   | 165     | 22,015     | 2028/09/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.7500 | 395   | 527     | 70,098     | 2044/09/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 4.5000 | 830   | 1,004   | 133,431    | 2024/03/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 3.7500 | 1,110 | 1,296   | 172,147    | 2024/09/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 3.5000 | 370   | 425     | 56,563     | 2030/03/01  |           |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国 債 証 券 | 2.1500 | 700   | 751     | 99,812     | 2021/12/15  |           |
| 国 小 計                   | 銘 柄 数<br>金 額                      | 28銘柄    |        |       | 28,279  | 34,333     | 4,559,831   |           |

| 2017年11月30日現在 |                         |         |        |             |             |              |            |
|---------------|-------------------------|---------|--------|-------------|-------------|--------------|------------|
| 区 分           | 銘 柄                     | 種 類     | 年 利 率  | 額 面 金 額     | 評 価 額       |              | 償 還 年 月 日  |
|               |                         |         |        |             | 外 貨 建 金 額   | 邦 貨 換 算 金 額  |            |
| ユーロ（フィンランド）   | Finland Government Bond | 国 債 証 券 | 0.7500 | 千ユーロ<br>190 | 千ユーロ<br>188 | 千円<br>25,028 | 2031/04/15 |
|               | Finland Government Bond | 国 債 証 券 | 0.5000 | 180         | 182         | 24,217       | 2026/04/15 |
|               | Finland Government Bond | 国 債 証 券 | 0.5000 | 200         | 199         | 26,442       | 2027/09/15 |
|               | Finland Government Bond | 国 債 証 券 | 4.3750 | 80          | 86          | 11,487       | 2019/07/04 |
|               | Finland Government Bond | 国 債 証 券 | 4.0000 | 200         | 257         | 34,136       | 2025/07/04 |
|               | Finland Government Bond | 国 債 証 券 | 3.3750 | 200         | 218         | 29,079       | 2020/04/15 |
|               | Finland Government Bond | 国 債 証 券 | 1.6250 | 380         | 413         | 54,969       | 2022/09/15 |
|               | Finland Government Bond | 国 債 証 券 | 2.6250 | 90          | 119         | 15,846       | 2042/07/04 |
|               | Finland Government Bond | 国 債 証 券 | 2.0000 | 350         | 392         | 52,187       | 2024/04/15 |
| 国 小 計         | 銘 柄 数<br>金 額            | 9銘柄     |        | 1,870       | 2,058       | 273,395      |            |
| ユーロ（オーストリア）   | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 1.2000 | 千ユーロ<br>440 | 千ユーロ<br>440 | 62,708       | 2025/10/20 |
|               | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 0.7500 | 320         | 328         | 43,646       | 2026/10/20 |
|               | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 0.5000 | 400         | 398         | 52,975       | 2027/04/20 |
|               | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 6.2500 | 80          | 124         | 16,494       | 2027/07/15 |
|               | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 3.9000 | 480         | 536         | 71,208       | 2020/07/15 |
|               | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 3.5000 | 360         | 414         | 55,013       | 2021/09/15 |
|               | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 4.1500 | 310         | 473         | 62,827       | 2037/03/15 |
|               | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 4.3500 | 480         | 511         | 67,872       | 2019/03/15 |
|               | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 3.4000 | 360         | 425         | 56,521       | 2022/11/22 |
|               | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 3.8000 | 270         | 455         | 60,491       | 2062/01/26 |
|               | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 3.1500 | 180         | 251         | 33,402       | 2044/06/20 |
|               | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 1.7500 | 430         | 476         | 63,238       | 2023/10/20 |
|               | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 2.4000 | 120         | 144         | 19,213       | 2034/05/23 |
|               | Austria Government Bond | 国 債 証 券 | 1.6500 | 280         | 309         | 41,133       | 2024/10/21 |
| 国 小 計         | 銘 柄 数<br>金 額            | 14銘柄    |        | 4,510       | 5,321       | 706,747      |            |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額            | 164銘柄   |        | 118,748     | 140,967     | 18,721,947   |            |
| 合 計           | 銘 柄 数<br>金 額            | 346銘柄   |        |             |             | 45,230,726   |            |

（注１）邦貨換算金額は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

（注２）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

| 銘 柄 別 |                          | 2017年11月30日現在 |          |
|-------|--------------------------|---------------|----------|
|       |                          | 買 建 額         | 売 建 額    |
| 外     | T-NOTE(10YR)(アメリカ)       | 百万円<br>83     | 百万円<br>－ |
|       | T-NOTE(5YR)(アメリカ)        | 104           | －        |
|       | T-NOTE(2YR)(アメリカ)        | 216           | －        |
|       | T-BOND(ULTRA LONG)(アメリカ) | 74            | －        |
|       | BUND(10YR)(ドイツ)          | 64            | －        |
| 国     | BUXL(30YR)(ドイツ)          | 66            | －        |
|       | BTP 10YR(イタリア)           | 37            | －        |
|       | OAT 10YR(フランス)           | 42            | －        |

（注１）外貨建の資産は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

（注２）単位未満は切捨て。

# 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

## 運用報告書 第1期（決算日 2017年6月15日）

（計算期間 2016年9月26日～2017年6月15日）

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの第1期にかかる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   | 投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。                                                                                                                                                                                         |
| 主要投資対象 | 外国の公社債                                                                                                                                                                                                                                              |
| 運用方法   | ①主として、外国の公社債に投資し、投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。<br>②運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>③投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させるため、外貨建資産については為替ヘッジを行ないます。 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の10%以下                                                                                                                                                                                                                                         |

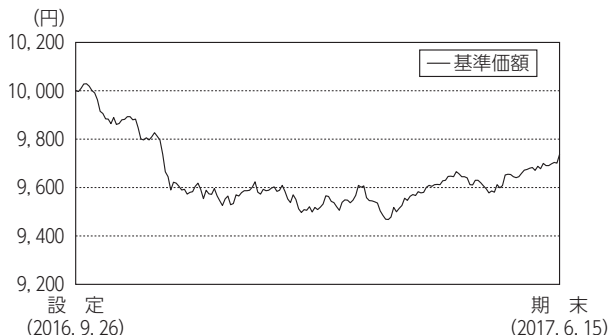
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日           | 基 準 価 額 |          | シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）<br>（ベンチマーク） |          | 公社債組入率<br>比 | 債券先比率 |
|-----------------|---------|----------|-------------------------------------------|----------|-------------|-------|
|                 | 円       | 騰落率<br>% | 10,000                                    | 騰落率<br>% |             |       |
| (設定) 2016年9月26日 | 10,000  | —        | 10,000                                    | —        | —           | —     |
| 9月末             | 10,019  | △ 0.2    | 10,024                                    | 0.2      | 95.8        | —     |
| 10月末            | 9,797   | △ 2.0    | 9,812                                     | △ 1.9    | 93.3        | 10.7  |
| 11月末            | 9,618   | △ 3.8    | 9,622                                     | △ 3.8    | 96.5        | 9.8   |
| 12月末            | 9,624   | △ 3.8    | 9,628                                     | △ 3.7    | 94.1        | 7.1   |
| 2017年1月末        | 9,506   | △ 4.9    | 9,514                                     | △ 4.9    | 92.0        | 6.9   |
| 2月末             | 9,601   | △ 4.0    | 9,612                                     | △ 3.9    | 95.1        | 3.9   |
| 3月末             | 9,578   | △ 4.2    | 9,592                                     | △ 4.1    | 95.2        | 8.2   |
| 4月末             | 9,630   | △ 3.7    | 9,643                                     | △ 3.6    | 96.4        | 3.2   |
| 5月末             | 9,680   | △ 3.2    | 9,694                                     | △ 3.1    | 96.3        | 3.8   |
| (期末) 2017年6月15日 | 9,737   | △ 2.6    | 9,751                                     | △ 2.5    | 93.8        | 4.0   |

(注1) 騰落率は設定比。

(注2) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。

(注3) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。

(注4) 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5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

設定時：10,000円 期末：9,737円 騰落率：△2.6%

【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、主要国の金利が上昇（債券価格の下落）したため、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○外国債券市況

主要国の国債金利は、設定時より、ECB（欧州中央銀行）の資産買い入れの減額観測が出たことなどから金利は上昇しました。また、2016年11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利し、今後の財政拡大などが意識されたことも、さらなる金利上昇の要因となりました。12月に米国で利上げが行なわれたことで米国の金利は上昇した一方、欧州では金融緩和が継続されたため金利は低下しました。その後、金利は上下に振れながらもおおむねレンジ内での推移となりました。2017年3月中旬以降は、トランプ政権の政策に対する不透明感などから金利はおおむね低下基調で推移しました。

◆ポートフォリオについて

外貨建て資産については為替ヘッジを行ない、またファンドとベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース））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

当期の当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率は、「当期中の基準価額と市況の推移」をご参照ください。当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0.2%程度でした。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

| 項 目                      | 当 期             |
|--------------------------|-----------------|
| 売買委託手数料<br>（先物）          | 1円<br>（1）       |
| 有価証券取引税                  | —               |
| その他費用<br>（保管費用）<br>（その他） | 3<br>（3）<br>（0） |
| 合 計                      | 4               |

(注1) 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、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

■売買および取引の状況

(1) 公 社 債

(2016年9月26日から2017年6月15日まで)

|   |                 |      | 買 付 額                   | 売 付 額                      |
|---|-----------------|------|-------------------------|----------------------------|
|   |                 |      | 千アメリカ・ドル                | 千アメリカ・ドル                   |
| 外 | アメリカ            | 国債証券 | 140, 556                | 10, 938<br>( — )           |
|   | カナダ             | 国債証券 | 千カナダ・ドル<br>8, 878       | 千カナダ・ドル<br>915<br>( — )    |
|   | オーストラリア         | 国債証券 | 千オーストラリア・ドル<br>8, 307   | 千オーストラリア・ドル<br>29<br>( — ) |
|   | シンガポール          | 国債証券 | 千シンガポール・ドル<br>1, 509    | 千シンガポール・ドル<br>—<br>( — )   |
|   | イギリス            | 国債証券 | 千イギリス・ポンド<br>16, 472    | 千イギリス・ポンド<br>—<br>( — )    |
|   | スイス             | 国債証券 | 千スイス・フラン<br>421         | 千スイス・フラン<br>—<br>( — )     |
|   | デンマーク           | 国債証券 | 千デンマーク・クローネ<br>11, 484  | 千デンマーク・クローネ<br>—<br>( — )  |
|   | ノルウェー           | 国債証券 | 千ノルウェー・クローネ<br>6, 312   | 千ノルウェー・クローネ<br>—<br>( — )  |
|   | スウェーデン          | 国債証券 | 千スウェーデン・クローネ<br>10, 384 | 千スウェーデン・クローネ<br>—<br>( — ) |
|   | メキシコ            | 国債証券 | 千メキシコ・ペソ<br>46, 073     | 千メキシコ・ペソ<br>—<br>( — )     |
| 国 | マレーシア           | 国債証券 | 千マレーシア・リンギット<br>4, 017  | 千マレーシア・リンギット<br>—<br>( — ) |
|   | 南アフリカ           | 国債証券 | 千南アフリカ・ランド<br>18, 738   | 千南アフリカ・ランド<br>—<br>( — )   |
|   | ポーランド           | 国債証券 | 千ポーランド・ズロチ<br>6, 700    | 千ポーランド・ズロチ<br>—<br>( — )   |
|   | ユーロ<br>(アイルランド) | 国債証券 | 千ユーロ<br>1, 993          | 千ユーロ<br>—<br>( — )         |
|   | ユーロ<br>(オランダ)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>5, 927          | 千ユーロ<br>—<br>( — )         |
|   | ユーロ<br>(ベルギー)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>6, 791          | 千ユーロ<br>—<br>( — )         |
|   |                 |      |                         |                            |

|   |                 |      | 買 付 額    | 売 付 額           |
|---|-----------------|------|----------|-----------------|
|   |                 |      | 千ユーロ     | 千ユーロ            |
| 外 | ユーロ<br>(フランス)   | 国債証券 | 27, 116  | 709<br>( — )    |
|   | ユーロ<br>(ドイツ)    | 国債証券 | 20, 411  | 1, 205<br>( — ) |
|   | ユーロ<br>(スペイン)   | 国債証券 | 15, 707  | 950<br>( — )    |
|   | ユーロ<br>(イタリア)   | 国債証券 | 25, 838  | 198<br>( — )    |
|   | ユーロ<br>(フィンランド) | 国債証券 | 1, 472   | —<br>( — )      |
|   | ユーロ<br>(オーストリア) | 国債証券 | 3, 941   | —<br>( — )      |
|   | ユーロ<br>(ユーロ通貨計) | 国債証券 | 109, 200 | 3, 064<br>( — ) |
| 国 |                 |      |          |                 |
|   |                 |      |          |                 |
|   |                 |      |          |                 |
|   |                 |      |          |                 |
|   |                 |      |          |                 |
|   |                 |      |          |                 |
|   |                 |      |          |                 |

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2016年9月26日から2017年6月15日まで)

| 種 類 別  | 買 建     |         | 売 建   |       |
|--------|---------|---------|-------|-------|
|        | 新規買付額   | 決 済 額   | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外 国    | 百万円     | 百万円     | 百万円   | 百万円   |
| 債券先物取引 | 35, 245 | 33, 932 | —     | —     |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2016年9月26日から2017年6月15日まで)

| 当 期                                                       |  |           | 期                                                       |  |         |
|-----------------------------------------------------------|--|-----------|---------------------------------------------------------|--|---------|
| 買 付                                                       |  | 金 額       | 売 付                                                     |  | 金 額     |
| 銘 柄                                                       |  |           | 銘 柄                                                     |  |         |
| 千円                                                        |  |           | 千円                                                      |  |         |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2018/12/31   |  | 1,597,033 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2018/4/30 |  | 631,556 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2021/11/15     |  | 941,299   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.5% 2018/2/15  |  | 449,252 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2019/10/31   |  | 938,207   | GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 0.25% 2018/4/13            |  | 128,885 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2019/12/31 |  | 783,755   | SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン) 0.25% 2018/4/30          |  | 97,785  |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2018/10/31  |  | 654,046   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/9/30 |  | 88,036  |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2018/4/30   |  | 648,619   | FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4% 2018/4/25              |  | 87,978  |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/9/30   |  | 621,588   | CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ) 0.25% 2018/5/1           |  | 75,900  |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2020/11/15 |  | 589,832   | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 4.5% 2036/2/15  |  | 42,686  |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.875% 2020/6/30  |  | 589,452   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア) 4.5% 2018/2/1  |  | 23,744  |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.125% 2021/6/30  |  | 566,644   | GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 3.5% 2019/7/4              |  | 19,848  |

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

| 作 成 期           | 当 期                   |                        |                  |           | 未                     |           |           |          |
|-----------------|-----------------------|------------------------|------------------|-----------|-----------------------|-----------|-----------|----------|
| 区 分             | 額 面 金 額               | 評 価 額                  |                  | 組入比率      | うちB B格<br>以下組入<br>比 率 | 残存期間別組入比率 |           |          |
|                 |                       | 外 貨 建 金 額              | 邦 貨 換 算 金 額      |           |                       | 5 年 以 上   | 2 年 以 上   | 2 年 未 満  |
| アメリカ            | 千アメリカ・ドル<br>127,503   | 千アメリカ・ドル<br>130,461    | 千円<br>14,314,191 | %<br>41.4 | %<br>—                | %<br>17.9 | %<br>16.1 | %<br>7.3 |
| カナダ             | 千カナダ・ドル<br>7,247      | 千カナダ・ドル<br>7,984       | 661,849          | 1.9       | —                     | 0.9       | 0.5       | 0.6      |
| オーストラリア         | 千オーストラリア・ドル<br>7,622  | 千オーストラリア・ドル<br>8,346   | 695,073          | 2.0       | —                     | 1.4       | 0.5       | 0.1      |
| シンガポール          | 千シンガポール・ドル<br>1,437   | 千シンガポール・ドル<br>1,514    | 120,713          | 0.3       | —                     | 0.2       | 0.1       | 0.0      |
| イギリス            | 千イギリス・ポンド<br>12,858   | 千イギリス・ポンド<br>16,819    | 2,353,159        | 6.8       | —                     | 4.8       | 1.7       | 0.3      |
| スイス             | 千スイス・フラン<br>352       | 千スイス・フラン<br>416        | 47,099           | 0.1       | —                     | 0.0       | 0.1       | —        |
| デンマーク           | 千デンマーク・クローネ<br>9,040  | 千デンマーク・クローネ<br>11,416  | 189,065          | 0.5       | —                     | 0.4       | 0.2       | 0.0      |
| ノルウェー           | 千ノルウェー・クローネ<br>5,920  | 千ノルウェー・クローネ<br>6,324   | 82,406           | 0.2       | —                     | 0.2       | 0.0       | 0.0      |
| スウェーデン          | 千スウェーデン・クローネ<br>8,800 | 千スウェーデン・クローネ<br>10,342 | 130,423          | 0.4       | —                     | 0.2       | 0.2       | —        |
| メキシコ            | 千メキシコ・ペソ<br>44,610    | 千メキシコ・ペソ<br>46,353     | 283,685          | 0.8       | —                     | 0.4       | 0.3       | 0.1      |
| マレーシア           | 千マレーシア・リンギット<br>4,100 | 千マレーシア・リンギット<br>4,068  | 104,962          | 0.3       | —                     | 0.2       | 0.1       | 0.1      |
| 南アフリカ           | 千南アフリカ・ランド<br>20,130  | 千南アフリカ・ランド<br>19,026   | 165,533          | 0.5       | —                     | 0.4       | 0.1       | —        |
| ポーランド           | 千ポーランド・ズロチ<br>6,645   | 千ポーランド・ズロチ<br>6,797    | 199,384          | 0.6       | —                     | 0.2       | 0.3       | 0.1      |
| ユーロ<br>(アイルランド) | 千ユーロ<br>1,698         | 千ユーロ<br>1,999          | 246,160          | 0.7       | —                     | 0.4       | 0.3       | —        |



外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

| 作 成 期           |                 | 当 期             |                |           | 末          |           |           |           |
|-----------------|-----------------|-----------------|----------------|-----------|------------|-----------|-----------|-----------|
| 区 分             | 額 面 金 額         | 評 価 額           |                | 組入比率      | うちＢＢ格以下組入率 | 残存期間別組入比率 |           |           |
|                 |                 | 外 貨 建 金 額       | 邦 貨 換 算 金 額    |           |            | 5 年 以 上   | 2 年 以 上   | 2 年 未 満   |
| ユーロ<br>(オランダ)   | 千ユーロ<br>4, 942  | 千ユーロ<br>5, 905  | 千円<br>726, 998 | %<br>2. 1 | %<br>—     | %<br>1. 4 | %<br>0. 4 | %<br>0. 3 |
| ユーロ<br>(ベルギー)   | 千ユーロ<br>5, 890  | 千ユーロ<br>6, 826  | 840, 362       | 2. 4      | —          | 1. 9      | 0. 4      | 0. 2      |
| ユーロ<br>(フランス)   | 千ユーロ<br>21, 646 | 千ユーロ<br>26, 637 | 3, 279, 393    | 9. 5      | —          | 5. 8      | 3. 0      | 0. 6      |
| ユーロ<br>(ドイツ)    | 千ユーロ<br>15, 919 | 千ユーロ<br>19, 072 | 2, 348, 025    | 6. 8      | —          | 4. 2      | 2. 1      | 0. 6      |
| ユーロ<br>(スペイン)   | 千ユーロ<br>12, 890 | 千ユーロ<br>14, 821 | 1, 824, 649    | 5. 3      | —          | 3. 1      | 1. 8      | 0. 4      |
| ユーロ<br>(イタリア)   | 千ユーロ<br>21, 536 | 千ユーロ<br>25, 648 | 3, 157, 614    | 9. 1      | —          | 5. 6      | 2. 9      | 0. 6      |
| ユーロ<br>(フィンランド) | 千ユーロ<br>1, 280  | 千ユーロ<br>1, 465  | 180, 380       | 0. 5      | —          | 0. 4      | 0. 1      | —         |
| ユーロ<br>(オーストリア) | 千ユーロ<br>3, 350  | 千ユーロ<br>3, 919  | 482, 551       | 1. 4      | —          | 0. 9      | 0. 3      | 0. 2      |
| ユーロ<br>(小計)     | 89, 151         | 106, 296        | 13, 086, 136   | 37. 9     | —          | 23. 8     | 11. 3     | 2. 8      |
| 合計              | —               | —               | 32, 433, 686   | 93. 8     | —          | 51. 0     | 31. 4     | 11. 5     |

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

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

| 区 分  | 銘 柄                              | 種 類  | 年利率     | 額 面 金 額            | 評 価 額              |                | 償還年月日      |
|------|----------------------------------|------|---------|--------------------|--------------------|----------------|------------|
|      |                                  |      |         |                    | 外 貨 建 金 額          | 邦 貨 換 算 金 額    |            |
| アメリカ | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 6250 | 千アメリカ・ドル<br>5, 120 | 千アメリカ・ドル<br>5, 306 | 千円<br>582, 214 | 2020/11/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 6250 | 4, 540             | 4, 870             | 534, 437       | 2021/02/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 0000 | 8, 346             | 8, 465             | 928, 808       | 2021/11/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 6250 | 3, 900             | 3, 864             | 424, 009       | 2022/11/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 1250 | 6, 950             | 6, 901             | 757, 277       | 2019/12/31 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 7500 | 2, 200             | 2, 187             | 240, 005       | 2023/05/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 8750 | 5, 240             | 5, 300             | 581, 625       | 2020/06/30 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 5000 | 3, 310             | 3, 431             | 376, 505       | 2023/08/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 2500 | 5, 945             | 5, 944             | 652, 233       | 2018/10/31 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 7500 | 4, 805             | 5, 056             | 554, 756       | 2023/11/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 5000 | 14, 160            | 14, 206            | 1, 558, 731    | 2018/12/31 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 5000 | 2, 380             | 2, 466             | 270, 617       | 2024/05/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 1250 | 4, 990             | 5, 087             | 558, 151       | 2021/06/30 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5. 3750 | 380                | 519                | 56, 957        | 2031/02/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 5000 | 550                | 719                | 78, 963        | 2036/02/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 5000 | 1, 330             | 1, 524             | 167, 269       | 2039/02/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 3750 | 410                | 528                | 58, 037        | 2039/11/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 6250 | 350                | 467                | 51, 263        | 2040/02/15 |

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

| 区 分     |            | 当 期                                  |      | 末      |             | 評 価 額       |            | 償還年月日      |
|---------|------------|--------------------------------------|------|--------|-------------|-------------|------------|------------|
|         |            | 銘 柄                                  | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額     | 外 貨 建 金 額   | 邦貨換算金額     |            |
|         |            |                                      |      | %      | 千アメリカ・ドル    | 千アメリカ・ドル    | 千円         |            |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 4.7500 | 670         | 914         | 100,320    | 2041/02/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 3.1250 | 1,870       | 2,001       | 219,602    | 2042/02/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 2.8750 | 720         | 735         | 80,645     | 2043/05/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 3.6250 | 1,100       | 1,279       | 140,426    | 2043/08/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 3.7500 | 332         | 394         | 43,305     | 2043/11/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 3.3750 | 2,100       | 2,346       | 257,430    | 2044/05/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 3.1250 | 3,190       | 3,408       | 373,957    | 2044/08/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 1.5000 | 8,440       | 8,461       | 928,416    | 2019/10/31 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 2.2500 | 2,410       | 2,452       | 269,092    | 2024/11/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 1.7500 | 3,550       | 3,556       | 390,265    | 2022/02/28 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 3.0000 | 1,570       | 1,637       | 179,660    | 2045/05/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 2.0000 | 3,220       | 3,204       | 351,584    | 2025/08/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 1.7500 | 4,870       | 4,863       | 533,582    | 2022/09/30 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 2.2500 | 2,300       | 2,329       | 255,626    | 2025/11/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 1.6250 | 1,165       | 1,119       | 122,800    | 2026/05/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 2.5000 | 2,070       | 1,948       | 213,740    | 2046/05/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 0.8750 | 3,020       | 2,993       | 328,491    | 2019/05/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 1.5000 | 1,000       | 948         | 104,052    | 2026/08/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 2.0000 | 1,550       | 1,532       | 168,178    | 2026/11/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 2.8750 | 2,230       | 2,268       | 248,879    | 2046/11/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 1.0000 | 2,900       | 2,873       | 315,289    | 2019/11/15 |
|         |            | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券 | 2.2500 | 2,320       | 2,342       | 256,976    | 2027/02/15 |
| 通貨小計    | 銘柄数<br>金 額 | 40銘柄                                 |      |        | 127,503     | 130,461     | 14,314,191 |            |
|         |            |                                      |      |        | 千カナダ・ドル     | 千カナダ・ドル     |            |            |
| カナダ     |            | Canada Government International Bond | 国債証券 | 2.7500 | 120         | 146         | 12,146     | 2064/12/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 5.7500 | 327         | 471         | 39,051     | 2029/06/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 5.7500 | 170         | 261         | 21,654     | 2033/06/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 5.0000 | 281         | 419         | 34,799     | 2037/06/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 4.0000 | 120         | 163         | 13,571     | 2041/06/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 3.5000 | 820         | 880         | 73,003     | 2020/06/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 3.5000 | 610         | 794         | 65,876     | 2045/12/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1.5000 | 398         | 404         | 33,549     | 2023/06/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 2.5000 | 230         | 249         | 20,642     | 2024/06/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1.7500 | 2,360       | 2,395       | 198,591    | 2019/03/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 2.2500 | 212         | 226         | 18,790     | 2025/06/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1.5000 | 260         | 261         | 21,714     | 2026/06/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 0.7500 | 759         | 749         | 62,088     | 2021/09/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 1.0000 | 240         | 228         | 18,973     | 2027/06/01 |
|         |            | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券 | 0.5000 | 340         | 330         | 27,396     | 2022/03/01 |
| 通貨小計    | 銘柄数<br>金 額 | 15銘柄                                 |      |        | 7,247       | 7,984       | 661,849    |            |
|         |            |                                      |      |        | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル |            |            |
| オーストラリア |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.2500 | 550         | 584         | 48,653     | 2019/03/15 |
|         |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.7500 | 750         | 859         | 71,613     | 2021/05/15 |
|         |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 4.5000 | 800         | 861         | 71,723     | 2020/04/15 |
|         |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.7500 | 630         | 744         | 62,001     | 2022/07/15 |
|         |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.5000 | 463         | 550         | 45,820     | 2023/04/21 |

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

| 区 分    |            | 当 期                        |      |        | 末           |             |         |
|--------|------------|----------------------------|------|--------|-------------|-------------|---------|
|        |            | 銘 柄                        | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額     | 評 価 額       |         |
|        |            |                            |      |        |             | 外 貨 建 金 額   | 邦貨換算金額  |
|        |            |                            |      |        | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円      |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 539         | 649         | 54,082  |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 506         | 524         | 43,644  |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 410         | 439         | 36,572  |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 530         | 566         | 47,197  |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 224         | 273         | 22,759  |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 518         | 596         | 49,646  |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 300         | 307         | 25,604  |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 185         | 205         | 17,081  |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 84          | 85          | 7,139   |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 958         | 935         | 77,892  |
|        |            | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 175         | 163         | 13,638  |
| 通貨小計   | 銘柄数<br>金 額 | 16銘柄                       |      |        | 7,622       | 8,346       | 695,073 |
|        |            |                            |      |        | 千シンガポール・ドル  | 千シンガポール・ドル  |         |
| シンガポール |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.5000 | 203         | 228         | 18,182  |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.5000 | 125         | 127         | 10,201  |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.2500 | 270         | 277         | 22,106  |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.7500 | 89          | 95          | 7,625   |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.7500 | 200         | 211         | 16,816  |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.3750 | 120         | 136         | 10,917  |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 1.6250 | 300         | 302         | 24,089  |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.3750 | 100         | 102         | 8,201   |
|        |            | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.7500 | 30          | 32          | 2,574   |
| 通貨小計   | 銘柄数<br>金 額 | 9銘柄                        |      |        | 1,437       | 1,514       | 120,713 |
|        |            |                            |      | %      | 千イギリス・ポンド   | 千イギリス・ポンド   |         |
| イギリス   |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 2.0000 | 550         | 606         | 84,791  |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 1.5000 | 400         | 418         | 58,611  |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 2.5000 | 320         | 428         | 59,903  |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 1.5000 | 275         | 290         | 40,606  |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 6.0000 | 283         | 435         | 60,943  |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 5.0000 | 275         | 365         | 51,145  |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 4.2500 | 705         | 1,015       | 142,085 |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 4.7500 | 790         | 890         | 124,654 |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 4.2500 | 620         | 991         | 138,729 |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 4.5000 | 331         | 526         | 73,619  |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 4.7500 | 907         | 1,305       | 182,656 |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 4.2500 | 373         | 619         | 86,718  |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 4.2500 | 780         | 1,157       | 161,981 |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 4.0000 | 540         | 635         | 88,976  |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 3.7500 | 1,045       | 1,130       | 158,194 |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 4.0000 | 377         | 668         | 93,566  |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 3.7500 | 270         | 301         | 42,221  |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 3.7500 | 742         | 853         | 119,364 |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 1.7500 | 280         | 300         | 42,038  |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 3.2500 | 255         | 339         | 47,514  |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 1.2500 | 751         | 760         | 106,396 |
|        |            | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 2.2500 | 640         | 709         | 99,284  |

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

| 区 分    |     | 当 期                       |      |         | 未                     |                       |               | 償還年月日      |
|--------|-----|---------------------------|------|---------|-----------------------|-----------------------|---------------|------------|
|        |     | 銘 柄                       | 種 類  | 年 利 率   | 額 面 金 額               | 評 価 額                 |               |            |
|        |     |                           |      |         |                       | 外 貨 建 金 額             | 邦貨換算金額        |            |
|        |     | United Kingdom Gilt       | 国債証券 | 3.5000% | 千イギリス・ポンド<br>578      | 千イギリス・ポンド<br>989      | 千円<br>138,394 | 2068/07/22 |
|        |     | United Kingdom Gilt       | 国債証券 | 3.5000  | 770                   | 1,077                 | 150,758       | 2045/01/22 |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 24銘柄                      |      |         |                       |                       |               |            |
|        | 金 額 |                           |      |         | 12,858                | 16,819                | 2,353,159     |            |
| スイス    |     | SWISS GOVERNMENT BOND     | 国債証券 | 4.0000  | 千スイス・フラン<br>82        | 千スイス・フラン<br>119       | 13,443        | 2028/04/08 |
|        |     | SWISS GOVERNMENT BOND     | 国債証券 | 2.2500  | 120                   | 131                   | 14,860        | 2020/07/06 |
|        |     | SWISS GOVERNMENT BOND     | 国債証券 | 2.0000  | 150                   | 166                   | 18,795        | 2021/04/28 |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 3銘柄                       |      |         |                       |                       |               |            |
|        | 金 額 |                           |      |         | 352                   | 416                   | 47,099        |            |
| デンマーク  |     | DANISH GOVERNMENT BOND    | 国債証券 | 4.5000  | 千デンマーク・クローネ<br>2,340  | 千デンマーク・クローネ<br>3,996  | 66,175        | 2039/11/15 |
|        |     | DANISH GOVERNMENT BOND    | 国債証券 | 4.0000  | 1,760                 | 1,950                 | 32,292        | 2019/11/15 |
|        |     | DANISH GOVERNMENT BOND    | 国債証券 | 3.0000  | 1,510                 | 1,733                 | 28,712        | 2021/11/15 |
|        |     | DANISH GOVERNMENT BOND    | 国債証券 | 1.5000  | 870                   | 958                   | 15,867        | 2023/11/15 |
|        |     | DANISH GOVERNMENT BOND    | 国債証券 | 1.7500  | 1,630                 | 1,843                 | 30,535        | 2025/11/15 |
|        |     | DANISH GOVERNMENT BOND    | 国債証券 | 0.2500  | 330                   | 334                   | 5,531         | 2018/11/15 |
|        |     | DANISH GOVERNMENT BOND    | 国債証券 | 0.5000  | 600                   | 600                   | 9,950         | 2027/11/15 |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 7銘柄                       |      |         |                       |                       |               |            |
|        | 金 額 |                           |      |         | 9,040                 | 11,416                | 189,065       |            |
| ノルウェー  |     | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000  | 千ノルウェー・クローネ<br>770    | 千ノルウェー・クローネ<br>827    | 10,783        | 2019/05/22 |
|        |     | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500  | 1,120                 | 1,245                 | 16,222        | 2021/05/25 |
|        |     | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000  | 1,150                 | 1,207                 | 15,733        | 2023/05/24 |
|        |     | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000  | 1,300                 | 1,448                 | 18,870        | 2024/03/14 |
|        |     | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500  | 150                   | 154                   | 2,014         | 2025/03/13 |
|        |     | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000  | 1,430                 | 1,441                 | 18,782        | 2026/02/19 |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 6銘柄                       |      |         |                       |                       |               |            |
|        | 金 額 |                           |      |         | 5,920                 | 6,324                 | 82,406        |            |
| スウェーデン |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 5.0000  | 千スウェーデン・クローネ<br>2,780 | 千スウェーデン・クローネ<br>3,314 | 41,795        | 2020/12/01 |
|        |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 3.5000  | 870                   | 1,216                 | 15,339        | 2039/03/30 |
|        |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 3.5000  | 1,450                 | 1,720                 | 21,698        | 2022/06/01 |
|        |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 1.5000  | 1,400                 | 1,534                 | 19,346        | 2023/11/13 |
|        |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 2.5000  | 1,020                 | 1,204                 | 15,193        | 2025/05/12 |
|        |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 1.0000  | 1,280                 | 1,352                 | 17,049        | 2026/11/12 |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 6銘柄                       |      |         |                       |                       |               |            |
|        | 金 額 |                           |      |         | 8,800                 | 10,342                | 130,423       |            |
| メキシコ   |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 5.0000  | 千メキシコ・ペソ<br>5,400     | 千メキシコ・ペソ<br>5,162     | 31,592        | 2019/12/11 |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 5.7500  | 1,700                 | 1,567                 | 9,594         | 2026/03/05 |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 8.0000  | 1,240                 | 1,307                 | 8,001         | 2023/12/07 |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 10.0000 | 4,940                 | 5,811                 | 35,567        | 2024/12/05 |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 7.5000  | 2,800                 | 2,903                 | 17,771        | 2027/06/03 |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 10.0000 | 1,250                 | 1,623                 | 9,933         | 2036/11/20 |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 8.5000  | 6,930                 | 7,076                 | 43,308        | 2018/12/13 |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 8.0000  | 1,500                 | 1,542                 | 9,439         | 2020/06/11 |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 6.5000  | 6,700                 | 6,594                 | 40,360        | 2021/06/10 |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 7.7500  | 2,200                 | 2,333                 | 14,278        | 2031/05/29 |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 6.5000  | 1,900                 | 1,863                 | 11,405        | 2022/06/09 |
|        |     |                           |      |         |                       |                       |               |            |

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

|              |                      | 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                 |                          |
|              |                      | Mexican Bonos<br>Mexican Bonos | 国債証券<br>国債証券 | %<br>7.7500<br>7.7500 | 千メキシコ・ペソ<br>4,750<br>3,300 | 千メキシコ・ペソ<br>5,059<br>3,508 | 千円<br>30,962<br>21,470 | 2042/11/13<br>2034/11/23 |
| 通貨小計         | 銘柄数<br>金 額           | 13銘柄                           |              |                       | 44,610                     | 46,353                     | 283,685                |                          |
| マレーシア        |                      | MALAYSIAN GOVERNMENT           | 国債証券         | 4.4980                | 千マレーシア・リンギット<br>260        | 千マレーシア・リンギット<br>264        | 6,815                  | 2030/04/15               |
|              |                      | MALAYSIAN GOVERNMENT           | 国債証券         | 3.5800                | 760                        | 763                        | 19,696                 | 2018/09/28               |
|              |                      | MALAYSIAN GOVERNMENT           | 国債証券         | 3.8920                | 400                        | 393                        | 10,154                 | 2027/03/15               |
|              |                      | MALAYSIAN GOVERNMENT           | 国債証券         | 3.4920                | 600                        | 599                        | 15,478                 | 2020/03/31               |
|              |                      | MALAYSIAN GOVERNMENT           | 国債証券         | 3.8440                | 600                        | 567                        | 14,640                 | 2033/04/15               |
|              |                      | MALAYSIAN GOVERNMENT           | 国債証券         | 3.9550                | 150                        | 149                        | 3,868                  | 2025/09/15               |
|              |                      | MALAYSIAN GOVERNMENT           | 国債証券         | 3.7950                | 200                        | 200                        | 5,185                  | 2022/09/30               |
|              |                      | MALAYSIAN GOVERNMENT           | 国債証券         | 3.8000                | 600                        | 598                        | 15,441                 | 2023/08/17               |
|              |                      | MALAYSIAN GOVERNMENT           | 国債証券         | 4.7360                | 130                        | 130                        | 3,356                  | 2046/03/15               |
|              | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券                           | 3.6200       | 400                   | 400                        | 10,324                     | 2021/11/30             |                          |
| 通貨小計         | 銘柄数<br>金 額           | 10銘柄                           |              |                       | 4,100                      | 4,068                      | 104,962                |                          |
| 南アフリカ        |                      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA       | 国債証券         | 7.2500                | 千南アフリカ・ランド<br>1,210        | 千南アフリカ・ランド<br>1,207        | 10,505                 | 2020/01/15               |
|              |                      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA       | 国債証券         | 10.5000               | 3,510                      | 3,990                      | 34,713                 | 2026/12/21               |
|              |                      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA       | 国債証券         | 6.7500                | 1,200                      | 1,170                      | 10,183                 | 2021/03/31               |
|              |                      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA       | 国債証券         | 6.5000                | 2,610                      | 1,882                      | 16,378                 | 2041/02/28               |
|              |                      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA       | 国債証券         | 7.7500                | 900                        | 895                        | 7,788                  | 2023/02/28               |
|              |                      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA       | 国債証券         | 8.7500                | 2,900                      | 2,668                      | 23,217                 | 2048/02/28               |
|              |                      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA       | 国債証券         | 8.5000                | 3,450                      | 3,158                      | 27,482                 | 2037/01/31               |
|              |                      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA       | 国債証券         | 8.0000                | 1,150                      | 1,072                      | 9,327                  | 2030/01/31               |
|              |                      | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA       | 国債証券         | 8.2500                | 3,200                      | 2,981                      | 25,935                 | 2032/03/31               |
| 通貨小計         | 銘柄数<br>金 額           | 9銘柄                            |              |                       | 20,130                     | 19,026                     | 165,533                |                          |
| ポーランド        |                      | Poland Government Bond         | 国債証券         | 5.7500                | 千ポーランド・ズロチ<br>200          | 千ポーランド・ズロチ<br>231          | 6,777                  | 2022/09/23               |
|              |                      | Poland Government Bond         | 国債証券         | 5.5000                | 1,120                      | 1,210                      | 35,508                 | 2019/10/25               |
|              |                      | Poland Government Bond         | 国債証券         | 1.5000                | 340                        | 334                        | 9,821                  | 2020/04/25               |
|              |                      | Poland Government Bond         | 国債証券         | 2.5000                | 640                        | 614                        | 18,025                 | 2026/07/25               |
|              |                      | Poland Government Bond         | 国債証券         | 1.7500                | 1,520                      | 1,483                      | 43,520                 | 2021/07/25               |
|              |                      | Poland Government Bond         | 国債証券         | 2.5000                | 315                        | 298                        | 8,763                  | 2027/07/25               |
|              |                      | Poland Government Bond         | 国債証券         | 5.7500                | 150                        | 189                        | 5,557                  | 2029/04/25               |
|              |                      | Poland Government Bond         | 国債証券         | 4.0000                | 710                        | 762                        | 22,364                 | 2023/10/25               |
|              |                      | Poland Government Bond         | 国債証券         | 2.5000                | 1,220                      | 1,233                      | 36,165                 | 2018/07/25               |
|              |                      | Poland Government Bond         | 国債証券         | 3.2500                | 430                        | 439                        | 12,881                 | 2025/07/25               |
| 通貨小計         | 銘柄数<br>金 額           | 10銘柄                           |              |                       | 6,645                      | 6,797                      | 199,384                |                          |
| ユーロ (アイルランド) |                      | IRISH TREASURY                 | 国債証券         | 4.4000                | 千ユーロ<br>290                | 千ユーロ<br>318                | 39,216                 | 2019/06/18               |
|              |                      | IRISH TREASURY                 | 国債証券         | 5.4000                | 288                        | 397                        | 48,890                 | 2025/03/13               |
|              |                      | IRISH TREASURY                 | 国債証券         | 5.0000                | 260                        | 307                        | 37,831                 | 2020/10/18               |
|              |                      | IRISH TREASURY                 | 国債証券         | 3.9000                | 170                        | 208                        | 25,672                 | 2023/03/20               |
|              |                      | IRISH TREASURY                 | 国債証券         | 3.4000                | 100                        | 121                        | 14,958                 | 2024/03/18               |

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

| 区 分       |     | 当 期                         |      |        | 末       |           |         |
|-----------|-----|-----------------------------|------|--------|---------|-----------|---------|
|           |     | 銘 柄                         | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額 | 評 価 額     |         |
|           |     |                             |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額  |
|           |     |                             |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円      |
|           |     | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 2.4000 | 120     | 138       | 17,076  |
|           |     | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 2.0000 | 160     | 167       | 20,601  |
|           |     | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 1.0000 | 120     | 123       | 15,225  |
|           |     | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 4.5000 | 190     | 216       | 26,686  |
| 国 小 計     | 銘柄数 | 9銘柄                         |      |        |         |           |         |
|           | 金 額 |                             |      |        | 1,698   | 1,999     | 246,160 |
| ユーロ（オランダ） |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 280     | 428       | 52,738  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 255     | 401       | 49,419  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 750     | 920       | 113,275 |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 300     | 315       | 38,824  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 175     | 197       | 24,305  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 280     | 449       | 55,315  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 192     | 221       | 27,305  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 270     | 341       | 42,008  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 550     | 567       | 69,826  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 220     | 311       | 38,356  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 380     | 434       | 53,547  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 350     | 358       | 44,110  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 220     | 222       | 27,350  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 220     | 224       | 27,634  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 300     | 305       | 37,595  |
|           |     | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 200     | 206       | 25,382  |
| 国 小 計     | 銘柄数 | 16銘柄                        |      |        |         |           |         |
|           | 金 額 |                             |      |        | 4,942   | 5,905     | 726,998 |
| ユーロ（ベルギー） |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 0.8000 | 350     | 365       | 45,010  |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 1.0000 | 572     | 577       | 71,037  |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 1.9000 | 260     | 290       | 35,708  |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 1.0000 | 595     | 627       | 77,210  |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 1.6000 | 334     | 334       | 41,221  |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 0.8000 | 480     | 491       | 60,486  |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 5.0000 | 200     | 328       | 40,499  |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 4.0000 | 200     | 242       | 29,793  |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 3.7500 | 534     | 609       | 75,056  |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 4.2500 | 515     | 820       | 100,978 |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 4.2500 | 730     | 906       | 111,549 |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 3.0000 | 200     | 216       | 26,656  |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 1.2500 | 420     | 427       | 52,688  |
|           |     | Belgium Government Bond     | 国債証券 | 2.6000 | 500     | 588       | 72,466  |
| 国 小 計     | 銘柄数 | 14銘柄                        |      |        |         |           |         |
|           | 金 額 |                             |      |        | 5,890   | 6,826     | 840,362 |
| ユーロ（フランス） |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 6.0000 | 1,235   | 1,829     | 225,231 |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 5.7500 | 180     | 302       | 37,281  |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 4.7500 | 930     | 1,477     | 181,955 |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 4.0000 | 872     | 1,432     | 176,395 |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND      | 国債証券 | 3.7500 | 650     | 756       | 93,101  |



外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

| 区 分      |     | 当 期                    |      |        | 末       |           |           |
|----------|-----|------------------------|------|--------|---------|-----------|-----------|
|          |     | 銘 柄                    | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額 | 評 価 額     |           |
|          |     |                        |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額    |
|          |     |                        |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円        |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 565     | 852       | 104,947   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 1,000   | 1,276     | 157,173   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 971     | 1,035     | 127,454   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 613     | 1,000     | 123,209   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 860     | 948       | 116,770   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 500     | 558       | 68,697    |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 1,040   | 1,326     | 163,256   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 870     | 958       | 117,952   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,514   | 1,755     | 216,078   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 1,300   | 1,510     | 185,918   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 860     | 1,045     | 128,660   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 395     | 447       | 55,080    |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 290     | 402       | 49,551    |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 830     | 922       | 113,616   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 100     | 115       | 14,206    |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 675     | 695       | 85,643    |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 2,066   | 2,484     | 305,906   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 1,060   | 1,187     | 146,169   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 2,020   | 2,072     | 255,093   |
|          |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 250     | 244       | 30,041    |
| 国 小 計    | 銘柄数 | 25銘柄                   |      |        |         |           |           |
|          | 金 額 |                        |      |        | 21,646  | 26,637    | 3,279,393 |
|          |     |                        |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |           |
| ユーロ（ドイツ） |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.5000 | 755     | 1,227     | 151,162   |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.2500 | 846     | 1,449     | 178,445   |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 60      | 99        | 12,237    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 190     | 315       | 38,794    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 610     | 966       | 118,956   |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 70      | 117       | 14,510    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 260     | 470       | 57,940    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 1,210   | 1,295     | 159,462   |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 734     | 798       | 98,244    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 306     | 462       | 56,912    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,355   | 1,518     | 186,898   |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 1,142   | 1,269     | 156,305   |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 448     | 603       | 74,328    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 400     | 442       | 54,448    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 560     | 639       | 78,709    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 500     | 566       | 69,701    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 400     | 544       | 67,073    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 470     | 524       | 64,623    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 790     | 825       | 101,608   |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 883     | 916       | 112,833   |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 250     | 246       | 30,368    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 300     | 302       | 37,279    |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,440   | 1,471     | 181,217   |
|          |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,940   | 1,997     | 245,964   |
| 国 小 計    | 銘柄数 | 24銘柄                   |      |        |         |           |           |
|          | 金 額 |                        |      |        | 15,919  | 19,072    | 2,348,025 |



外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

| 区 分                     |                                   | 当 期    |        |               | 末             |              |            | 償還年月日 |
|-------------------------|-----------------------------------|--------|--------|---------------|---------------|--------------|------------|-------|
|                         |                                   | 銘 柄    | 種 類    | 年利率           | 額 面 金 額       | 評 価 額        |            |       |
|                         |                                   |        |        |               |               | 外 貨 建 金 額    | 邦貨換算金額     |       |
| ユーロ（スペイン）               | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 6.0000 | 千ユーロ<br>550   | 千ユーロ<br>809   | 千円<br>99,611 | 2029/01/31 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 1.9500 | 610           | 622           | 76,634       | 2030/07/30 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 2.1500 | 1,095         | 1,187         | 146,215      | 2025/10/31 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 0.2500 | 1,000         | 1,008         | 124,203      | 2019/01/31 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 2.9000 | 469           | 487           | 59,984       | 2046/10/31 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 1.3000 | 1,349         | 1,356         | 167,040      | 2026/10/31 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 5.7500 | 280           | 420           | 51,797       | 2032/07/30 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 4.2000 | 450           | 584           | 71,989       | 2037/01/31 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 4.6000 | 1,238         | 1,365         | 168,161      | 2019/07/30 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 4.7000 | 483           | 674           | 82,994       | 2041/07/30 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 4.8500 | 100           | 116           | 14,388       | 2020/10/31 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 5.5000 | 724           | 880           | 108,433      | 2021/04/30 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 5.8500 | 840           | 1,063         | 130,936      | 2022/01/31 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 5.4000 | 210           | 269           | 33,129       | 2023/01/31 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 4.4000 | 888           | 1,102         | 135,734      | 2023/10/31 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 5.1500 | 140           | 207           | 25,589       | 2044/10/31 |       |
|                         | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 2.7500 | 984           | 1,117         | 137,608      | 2024/10/31 |       |
| SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券                              | 1.4000 | 1,480  | 1,544         | 190,196       | 2020/01/31   |            |       |
| 国 小 計                   | 銘柄数                               | 18銘柄   |        |               |               |              |            |       |
|                         | 金 額                               |        |        | 12,890        | 14,821        | 1,824,649    |            |       |
| ユーロ（イタリア）               | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 6.5000 | 千ユーロ<br>1,035 | 千ユーロ<br>1,475 | 181,619      | 2027/11/01 |       |
|                         | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 3.2500 | 545           | 566           | 69,749       | 2046/09/01 |       |
|                         | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 1.5000 | 820           | 815           | 100,433      | 2025/06/01 |       |
|                         | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 0.6500 | 200           | 194           | 23,908       | 2023/10/15 |       |
|                         | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券   | 2.8000 | 160           | 138           | 17,090       | 2067/03/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 5.2500 | 340           | 452           | 55,739       | 2029/11/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 6.0000 | 1,288         | 1,848         | 227,576      | 2031/05/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 5.0000 | 850           | 1,132         | 139,468      | 2034/08/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.0000 | 770           | 924           | 113,807      | 2037/02/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 3.7500 | 702           | 797           | 98,218       | 2021/08/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 5.0000 | 220           | 297           | 36,606       | 2039/08/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.7500 | 850           | 1,037         | 127,760      | 2023/08/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.5000 | 1,497         | 1,578         | 194,363      | 2018/08/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.2500 | 2,970         | 3,253         | 400,481      | 2019/09/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 5.0000 | 164           | 219           | 27,031       | 2040/09/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.0000 | 1,650         | 1,852         | 228,071      | 2020/09/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.5000 | 1,070         | 1,313         | 161,704      | 2026/03/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 3.7500 | 150           | 169           | 20,844       | 2021/03/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.7500 | 1,320         | 1,556         | 191,635      | 2021/09/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 5.0000 | 530           | 637           | 78,477       | 2022/03/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 5.5000 | 1,670         | 2,078         | 255,826      | 2022/11/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.7500 | 130           | 164           | 20,223       | 2028/09/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.7500 | 525           | 684           | 84,252       | 2044/09/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 4.5000 | 1,150         | 1,388         | 170,921      | 2024/03/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 3.7500 | 560           | 649           | 79,963       | 2024/09/01 |       |
|                         | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券   | 3.5000 | 370           | 421           | 51,836       | 2030/03/01 |       |
|                         | 国 小 計                             | 銘柄数    | 26銘柄   |               |               |              |            |       |
| 金 額                     |                                   |        |        | 21,536        | 25,648        | 3,157,614    |            |       |

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

| 区 分         |     | 当 期                     |      |         | 末           |             |             |
|-------------|-----|-------------------------|------|---------|-------------|-------------|-------------|
|             |     | 銘 柄                     | 種 類  | 年利率     | 額 面 金 額     | 評 価 額       |             |
|             |     |                         |      |         |             | 外 貨 建 金 額   | 邦貨換算金額      |
| ユーロ（フィンランド） |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 0.7500% | 千ユーロ<br>80  | 千ユーロ<br>80  | 千円<br>9,849 |
|             |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 0.5000  | 180         | 183         | 22,557      |
|             |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 4.3750  | 80          | 88          | 10,870      |
|             |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 4.0000  | 200         | 262         | 32,289      |
|             |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 3.3750  | 200         | 222         | 27,399      |
|             |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 1.6250  | 100         | 109         | 13,534      |
|             |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 2.6250  | 90          | 120         | 14,869      |
|             |     | Finland Government Bond | 国債証券 | 2.0000  | 350         | 398         | 49,012      |
| 国 小 計       | 銘柄数 | 8銘柄                     |      |         |             |             |             |
|             | 金 額 |                         |      |         | 1,280       | 1,465       | 180,380     |
| ユーロ（オーストリア） |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.2000  | 千ユーロ<br>320 | 千ユーロ<br>345 | 42,550      |
|             |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 0.7500  | 320         | 330         | 40,645      |
|             |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 0.5000  | 400         | 400         | 49,318      |
|             |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 6.2500  | 80          | 126         | 15,615      |
|             |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.9000  | 280         | 318         | 39,217      |
|             |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.5000  | 360         | 420         | 51,769      |
|             |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.1500  | 210         | 325         | 40,094      |
|             |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.3500  | 480         | 522         | 64,271      |
|             |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.4000  | 260         | 311         | 38,368      |
|             |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.8000  | 80          | 138         | 17,073      |
|             |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.1500  | 130         | 185         | 22,805      |
|             |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.7500  | 230         | 257         | 31,665      |
|             |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 2.4000  | 120         | 147         | 18,178      |
|             |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.6500  | 80          | 89          | 10,976      |
| 国 小 計       | 銘柄数 | 14銘柄                    |      |         |             |             |             |
|             | 金 額 |                         |      |         | 3,350       | 3,919       | 482,551     |
| 通貨小計        | 銘柄数 | 154銘柄                   |      |         |             |             |             |
|             | 金 額 |                         |      |         | 89,151      | 106,296     | 13,086,136  |
| 合 計         | 銘柄数 | 322銘柄                   |      |         |             |             |             |
|             | 金 額 |                         |      |         |             |             | 32,433,686  |

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

（注 2）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

| 銘 柄 別 |                            | 当 期 末 |       |
|-------|----------------------------|-------|-------|
|       |                            | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外     | T-BOND (LONG BOND) (アメリカ)  | 51    | —     |
|       | T-NOTE (10YR) (アメリカ)       | 27    | —     |
|       | T-NOTE (5YR) (アメリカ)        | 246   | —     |
|       | T-NOTE (2YR) (アメリカ)        | 261   | —     |
|       | T-BOND (ULTRA LONG) (アメリカ) | 91    | —     |
| 国     | BUND (10YR) (ドイツ)          | 122   | —     |
|       | BOBL (5YR) (ドイツ)           | 196   | —     |
|       | SCHATZ (2YR) (ドイツ)         | 179   | —     |
|       | BUXL (30YR) (ドイツ)          | 83    | —     |
|       | BTP 10YR (イタリア)            | 50    | —     |
|       | OAT 10YR (フランス)            | 55    | —     |

(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

2017年 6 月15日現在

| 項 目          | 当 期 末        |        |
|--------------|--------------|--------|
|              | 評 価 額        | 比 率    |
| 公社債          | 32, 433, 686 | 93. 8  |
| コール・ローン等、その他 | 2, 161, 088  | 6. 2   |
| 投資信託財産総額     | 34, 594, 774 | 100. 0 |

(注 1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注 2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝109.72円、1カナダ・ドル＝82.89円、1オーストラリア・ドル＝83.28円、1シンガポール・ドル＝79.70円、1イギリス・ポンド＝139.91円、1スイス・フラン＝112.97円、1デンマーク・クローネ＝16.56円、1ノルウェー・クローネ＝13.03円、1スウェーデン・クローネ＝12.61円、1メキシコ・ペソ＝6.12円、1マレーシア・リンギット＝25.80円、1南アフリカ・ランド＝8.70円、1ポーランド・ズロチ＝29.33円、1ユーロ＝123.11円です。

(注 3) 当期末における外貨建純資産（32,888,862千円）の投資信託財産総額（34,594,774千円）に対する比率は、95.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年 6 月15日現在

| 項 目            | 当 期 末              |
|----------------|--------------------|
| (A)資産          | 67, 257, 757, 690円 |
| コール・ローン等       | 1, 523, 893, 654   |
| 公社債（評価額）       | 32, 433, 686, 304  |
| 未収入金           | 32, 964, 858, 789  |
| 未収利息           | 184, 791, 560      |
| 前払費用           | 83, 164, 813       |
| 差入委託証拠金        | 67, 362, 570       |
| (B)負債          | 32, 696, 952, 040  |
| 未払金            | 32, 696, 952, 040  |
| (C)純資産総額（A－B）  | 34, 560, 805, 650  |
| 元本             | 35, 493, 735, 600  |
| 次期繰越損益金        | △ 932, 929, 950    |
| (D)受益権総口数      | 35, 493, 735, 600口 |
| 1万口当り基準価額（C／D） | 9, 737円            |

\* 設定時における元本額は99,800,000円、当期中における追加設定元本額は35,619,931,355円、同解約元本額は225,995,755円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）34,623,272,579円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）849,644,497円、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）20,818,524円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,737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932,929,950円です。

■損益の状況

当期 自2016年 9月26日 至2017年 6月15日

| 項 目               | 当 期                |
|-------------------|--------------------|
| (A)配当等収益          | 311, 261, 753円     |
| 受取利息              | 311, 881, 708      |
| 支払利息              | △ 619, 955         |
| (B)有価証券売買損益       | 73, 579, 262       |
| 売買益               | 2, 044, 486, 776   |
| 売買損               | △ 1, 970, 907, 514 |
| (C)先物取引等損益        | 26, 962, 229       |
| 取引益               | 71, 903, 846       |
| 取引損               | △ 44, 941, 617     |
| (D)その他費用          | △ 5, 374, 556      |
| (E)当期損益金（A＋B＋C＋D） | 406, 428, 688      |
| (F)解約差損益金         | 8, 396, 785        |
| (G)追加信託差損益金       | △ 1, 347, 755, 423 |
| (H)合計（E＋F＋G）      | △ 932, 929, 950    |
| 次期繰越損益金（H）        | △ 932, 929, 950    |

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

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

# ダイワファンドラップオンライン 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）

## ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                           |
|-----------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| 商 品 分 類                     | 追加型投信／海外／債券                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                           |
| 信 託 期 間                     | 無期限                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                           |
| 運 用 方 針                     | 海外の債券市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                           |
| 主要投資対象                      | ベ ビ ー ファ ン ド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | イ、外国債券インデックスマザーファンドの受益証券<br>ロ、ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券 |
|                             | 外国債券インデックスマザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 外国の公社債                                                    |
|                             | ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 新興国通貨建ての債券                                                |
| ベビーファンドの運用方法                | ①主として、海外の債券指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の債券市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。<br>②各マザーファンドの受益証券への投資にあたっては、下記の組入比率を目標に行ないます。<br>外国債券インデックスマザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の80％<br>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…信託財産の純資産総額の20％<br>③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。                                                                         |                                                           |
| 外国債券インデックスマザーファンドの運用方法      | ①主として外国の公社債に投資し、投資成果をシティ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。<br>②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。                                                                                                                                   |                                                           |
| ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの運用方法 | ①主として、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・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。<br>②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。 |                                                           |
| 組 入 制 限                     | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 無制限                                                       |
|                             | 外国債券インデックスマザーファンドの株式組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 純資産総額の30％以下                                               |
|                             | ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの株式組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 純資産総額の10％以下                                               |
| 分 配 方 針                     | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目指すに、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。                                                                                                                                                                                             |                                                           |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

## 運用報告書（全体版） 第 1 期 （決算日 2017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。

さて、「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）」は、このたび、第1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

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）

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

設定以来の運用実績

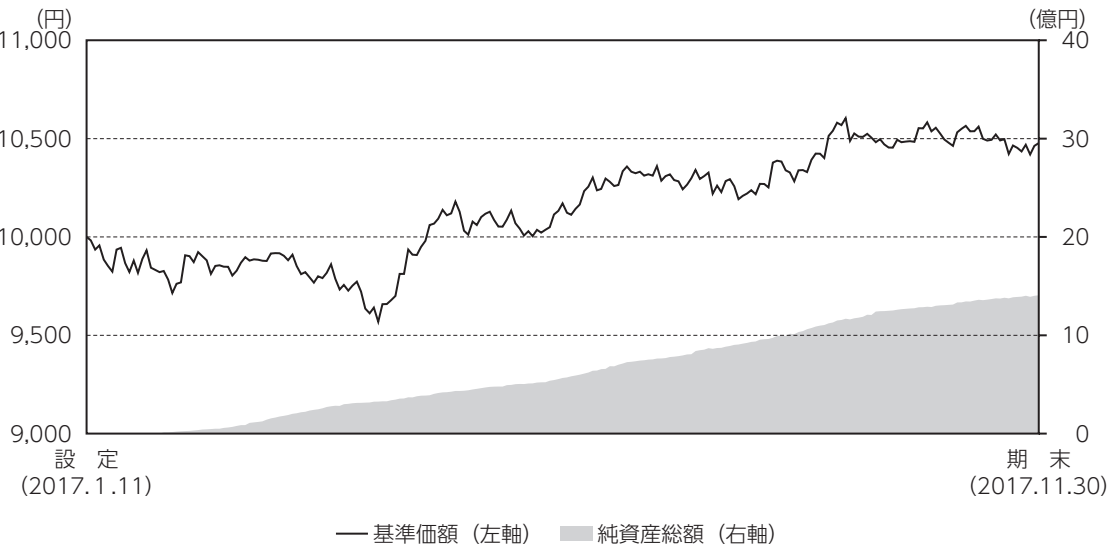
| 決 算 期             | 基 準 価 額     | 公 社 債 率 |               | 債 券 先 物 率 | 純 資 産 額      |
|-------------------|-------------|---------|---------------|-----------|--------------|
|                   |             | 税 込 分   | み 配 金 騰 落 中 率 |           |              |
| 1 期末（2017年11月30日） | 円<br>10,477 | 円<br>0  | %<br>4.8      | %<br>97.9 | 百万円<br>1,406 |

（注 1）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 2）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 3）債券先物比率は買建比率－売建比率です。  
（注 4）当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



#### ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円  
期 末：10,477円  
騰落率：4.8%

#### ■組入ファンドの当期中の騰落率と期末の組入比率

| 組入ファンド                 | 騰落率  | 比率    |
|------------------------|------|-------|
| 外国債券インデックスマザーファンド      | 4.2% | 79.8% |
| ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド | 8.1% | 20.1% |

#### ■基準価額の主な変動要因

主に海外の債券に投資した結果、利息収入やユーロなどの対円為替レートの上昇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。

| 年 月 日             | 基 準 価 額     |        | 公 社 債 率 | 債 券 先 物 率 |
|-------------------|-------------|--------|---------|-----------|
|                   |             | 騰 落 率  |         |           |
| (設定) 2017年 1 月11日 | 円<br>10,000 | %<br>— | %<br>—  | %<br>—    |
| 1 月末              | 9,844       | △1.6   | 97.7    | —         |
| 2 月末              | 9,829       | △1.7   | 97.8    | —         |
| 3 月末              | 9,861       | △1.4   | 98.0    | —         |
| 4 月末              | 9,908       | △0.9   | 98.3    | —         |
| 5 月末              | 10,052      | 0.5    | 97.8    | —         |
| 6 月末              | 10,237      | 2.4    | 97.8    | —         |
| 7 月末              | 10,242      | 2.4    | 97.9    | —         |
| 8 月末              | 10,388      | 3.9    | 98.0    | —         |
| 9 月末              | 10,509      | 5.1    | 98.3    | —         |
| 10月末              | 10,463      | 4.6    | 98.1    | —         |
| (期末) 2017年11月30日  | 10,477      | 4.8    | 97.9    | —         |

(注) 騰落率は設定比。



## 投資環境について

(2017.1.11～2017.11.30)

### ■外国債券市況

先進国債券市場は、設定時より、上下に振れながらもおおむねレンジ内で推移しましたが、2017年3月中旬以降は、米国トランプ政権の政策に対する不透明感などから金利は低下基調となりました。6月下旬以降は、ECB（欧州中央銀行）やBOC（カナダ銀行）などが金融緩和姿勢を後退させる中で、ドイツやカナダなどを中心に金利が上昇しました。しかしその後、米国の政治動向の不透明感や地政学リスクの高まりなどから、金利は低下基調で推移しました。9月には、米国の2017年中の追加利上げ観測の高まりなどを背景に金利は上昇しましたが、その後は、金利はレンジ内での推移が続きました。

新興国債券市場は、インフレ率が低位で推移する中、利下げを行なった国も多く、それらの国の金利は低下基調で推移しました。

### ■為替相場

先進国為替相場は、期を通じてユーロなどの欧州の通貨が対円で上昇しました。設定時より、トランプ政権に対する期待感の後退や欧州の政治情勢の不透明感などから円高傾向となりましたが、2017年4月半ばからは、フランス大統領選挙の結果などを受けて、ユーロが上昇傾向となった一方で円は下落傾向となりました。5月にはいったん円高となる場面も見られましたが、6月中旬に入り先進各国の中央銀行が金融緩和姿勢を後退させる中で内外の金利差が拡大傾向となったことなどから、円は下落傾向となりました。7月以降は、地政学リスクの高まりなどから円高傾向となりました。9月以降は、米国の2017年中の追加利上げ観測の高まりなどを背景に円安が進んだ後、米国の低インフレへの懸念などから円高に転じました。

新興国為替相場は、米国の政権運営への懸念は下落（円高）要因となった一方で、米国金利の上昇が抑制された場面では高金利通貨への需要につながり上昇（円安）要因となりました。

## ポートフォリオについて

(2017.1.11～2017.11.30)

### ■当ファンド

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

### ■外国債券インデックスマザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

## ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマーク（ＪＰモルガン ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド（円換算））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

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

## 分配金について

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

## ■分配原資の内訳（１万口当り）

| 項 目        |     | 当 期                        |
|------------|-----|----------------------------|
|            |     | 2017年1月11日<br>～2017年11月30日 |
| 当期分配金（税込み） | (円) | —                          |
| 対基準価額比率    | (%) | —                          |
| 当期の収益      | (円) | —                          |
| 当期の収益以外    | (円) | —                          |
| 翌期繰越分配対象額  | (円) | 476                        |

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■外国債券インデックスマザーファンド

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

### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

| 項 目       | 当期<br>(2017.1.11~2017.11.30) |         | 項 目 の 概 要                                                          |
|-----------|------------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------|
|           | 金 額                          | 比 率     |                                                                    |
| 信 託 報 酬   | 24円                          | 0.240%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は10,145円です。                       |
| (投 信 会 社) | (18)                         | (0.172) | 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、目<br>論見書・運用報告書の作成等の対価         |
| (販 売 会 社) | (5)                          | (0.048) | 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<br>の情報提供等の対価                |
| (受 託 銀 行) | (2)                          | (0.019) | 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＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<br>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＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>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 | 6                            | 0.063   | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数                                          |
| (保 管 費 用) | (6)                          | (0.055) | 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・<br>資産の移転等に要する費用             |
| (監 査 費 用) | (1)                          | (0.007) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                        |
| (そ の 他)   | (0)                          | (0.001) | 信託事務の処理等に関するその他の費用                                                 |
| 合 計       | 31                           | 0.303   |                                                                    |

(注1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

|                        | 設 定     |           | 解 約   |       |
|------------------------|---------|-----------|-------|-------|
|                        | □ 数     | 金 額       | □ 数   | 金 額   |
|                        | 千□      | 千円        | 千□    | 千円    |
| ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド | 204,656 | 278,191   | 1,476 | 2,043 |
| 外国債券インデックスマザーファンド      | 401,941 | 1,092,450 | 1,917 | 5,357 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

| 設定時保有額 | 期中設定額 | 期中解約額 | 期末保有額 | 取 引 の 理 由        |
|--------|-------|-------|-------|------------------|
| 百万円    | 百万円   | 百万円   | 百万円   | 当初設定時における取得とその処分 |
| 1      | －     | 1     | －     |                  |

(注1) 金額は元本ベース。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

| 種 類                    | 当 期 末   |           |
|------------------------|---------|-----------|
|                        | □ 数     | 評 価 額     |
|                        | 千□      | 千円        |
| ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド | 203,180 | 282,359   |
| 外国債券インデックスマザーファンド      | 400,023 | 1,123,066 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月30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 | 282,359   | 20.0  |
| 外国債券インデックスマザーファンド      | 1,123,066 | 79.7  |
| コール・ローン等、その他           | 3,483     | 0.3   |
| 投資信託財産総額               | 1,408,909 | 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＝112.05円、1 カナダ・ドル＝87.10円、1 オーストラリア・ドル＝84.87円、1 シンガポール・ドル＝83.19円、1 イギリス・ポンド＝150.33円、1 スイス・フラン＝113.83円、1 トルコ・リラ＝28.31円、1 デンマーク・クローネ＝17.84円、1 ノルウェー・クローネ＝13.58円、1 スウェーデン・クローネ＝13.38円、1 メキシコ・ペソ＝6.03円、1 フィリピン・ペソ＝2.23円、1 アルゼンチン・ペソ＝6.43円、100チリ・ペソ＝17.40円、100コロンビア・ペソ＝3.73円、100インドネシア・ルピア＝0.83円、1ブラジル・レアル＝34.53円、1チェコ・コルナ＝5.21円、1 ルーマニア・レイ＝28.61円、1 ロシア・ルーブル＝1.91円、1 マレーシア・リンギット＝27.42円、1 南アフリカ・ランド＝8.20円、1 タイ・バーツ＝3.44円、1 ペルー・ソル＝34.63円、1 ポーランド・ズロチ＝31.60円、100ハンガリー・フォリント＝42.54円、1 ウルグアイ・ペソ＝3.87円、1 ユーロ＝132.81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（7,139,216千円）の投資信託財産総額（7,304,763千円）に対する比率は、97.7%です。  
外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（165,668,822千円）の投資信託財産総額（166,838,087千円）に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

| 項 目                         | 当 期 末          |
|-----------------------------|----------------|
| (A) 資産                      | 1,408,909,919円 |
| コール・ローン等                    | 3,483,762      |
| ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額) | 282,359,623    |
| 外国債券インデックスマザーファンド(評価額)      | 1,123,066,534  |
| (B) 負債                      | 2,122,233      |
| 未払解約金                       | 931,271        |
| 未払信託報酬                      | 1,156,335      |
| その他未払費用                     | 34,627         |
| (C) 純資産総額(A－B)              | 1,406,787,686  |
| 元本                          | 1,342,783,335  |
| 次期繰越損益金                     | 64,004,351     |
| (D) 受益権総口数                  | 1,342,783,335口 |
| 1万口当り基準価額(C／D)              | 10,477円        |

\* 設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は1,434,988,289円、同解約元本額は93,204,954円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,477円です。

■損益の状況

当期 自2017年1月11日 至2017年11月30日

| 項 目                  | 当 期           |
|----------------------|---------------|
| (A) 配当等収益            | △ 698円        |
| 受取利息                 | 21            |
| 支払利息                 | △ 719         |
| (B) 有価証券売買損益         | 39,134,152    |
| 売買益                  | 42,193,402    |
| 売買損                  | △ 3,059,250   |
| (C) 信託報酬等            | △ 1,589,686   |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 37,543,768    |
| (E) 追加信託差損益金         | 26,460,583    |
| (配当等相当額)             | (△ 346)       |
| (売買損益相当額)            | ( 26,460,929) |
| (F) 合計(D + E)        | 64,004,351    |
| 次期繰越損益金(F)           | 64,004,351    |
| 追加信託差損益金             | 26,460,583    |
| (配当等相当額)             | (△ 346)       |
| (売買損益相当額)            | ( 26,460,929) |
| 分配準備積立金              | 37,544,466    |
| 繰越損益金                | △ 698         |

(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「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■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        | 37,544,466     |
| (c) 収益調整金                  | 26,460,929     |
| (d) 分配準備積立金                | 0              |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 64,005,395     |
| (f) 分配金                    | 0              |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f)       | 64,005,395     |
| (h) 受益権総口数                 | 1,342,783,335口 |

<補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の決算日（2017年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017年11月30日）現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を205～211ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄  
公 社 債

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

| 買                                                            |   | 付       | 売                                                            |   | 付       |
|--------------------------------------------------------------|---|---------|--------------------------------------------------------------|---|---------|
| 銘                                                            | 柄 | 金 額     | 銘                                                            | 柄 | 金 額     |
|                                                              |   | 千円      |                                                              |   | 千円      |
| Chile Government International Bond (チリ) 5.5% 2020/8/5       |   | 116,125 | Chile Government International Bond (チリ) 5.5% 2020/8/5       |   | 112,427 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/7/1            |   | 98,715  | Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/10/1           |   | 41,060  |
| Russian Federal Bond - OFZ (ロシア) 7.7% 2033/3/23              |   | 58,976  | Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/7/1            |   | 39,175  |
| Colombian TES (コロンビア) 7.5% 2026/8/26                         |   | 58,574  | Poland Government Bond (ポーランド) 2018/10/25                    |   | 38,774  |
| BONOS TESORERIA PESOS (チリ) 4.5% 2026/3/1                     |   | 57,325  | Malaysia Government Investment Issue (マレーシア) 4.07% 2026/9/30 |   | 35,671  |
| BONOS TESORERIA PESOS (チリ) 5% 2035/3/1                       |   | 57,305  | Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2018/7/25                |   | 28,904  |
| Mexican Bonos (メキシコ) 8% 2020/6/11                            |   | 56,140  | Mexican Bonos (メキシコ) 4.75% 2018/6/14                         |   | 28,185  |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/4/1            |   | 55,748  | MALAYSIAN GOVERNMENT (マレーシア) 4.048% 2021/9/30                |   | 26,937  |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1 |   | 50,796  | Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/4/1            |   | 25,768  |
| Mexican Bonos (メキシコ) 10% 2024/12/5                           |   | 48,050  | Poland Government Bond (ポーランド) 3.75% 2018/4/25               |   | 21,956  |

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

■組入資産明細表

下記は、2017年11月30日現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（5,227,992千口）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

| 区 分    | 2017年11月30日現在             |                           |               |          |                     |                   |          |          |
|--------|---------------------------|---------------------------|---------------|----------|---------------------|-------------------|----------|----------|
|        | 額 面 金 額                   | 評 価 額                     |               | 組 入 比 率  | う ち B B 格<br>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  |
| トルコ    | 千トルコ・リラ<br>17,990         | 千トルコ・リラ<br>16,067         | 千円<br>454,859 | %<br>6.3 | %<br>－              | %<br>2.9          | %<br>2.8 | %<br>0.6 |
| メキシコ   | 千メキシコ・ペソ<br>111,940       | 千メキシコ・ペソ<br>115,567       | 696,874       | 9.6      | －                   | 5.4               | 3.6      | 0.6      |
| フィリピン  | 千フィリピン・ペソ<br>10,000       | 千フィリピン・ペソ<br>10,312       | 22,996        | 0.3      | －                   | －                 | 0.3      | －        |
| アルゼンチン | 千アルゼンチン・ペソ<br>11,100      | 千アルゼンチン・ペソ<br>11,262      | 72,415        | 1.0      | 1.0                 | 0.6               | 0.4      | －        |
| チリ     | 千チリ・ペソ<br>975,000         | 千チリ・ペソ<br>994,535         | 173,049       | 2.4      | －                   | 1.7               | 0.7      | －        |
| コロンビア  | 千コロンビア・ペソ<br>11,875,000   | 千コロンビア・ペソ<br>12,959,195   | 483,377       | 6.7      | －                   | 4.1               | 2.1      | 0.5      |
| インドネシア | 千インドネシア・ルピア<br>75,449,000 | 千インドネシア・ルピア<br>82,760,869 | 686,915       | 9.5      | －                   | 7.4               | 1.6      | 0.5      |
| ブラジル   | 千ブラジル・レアル<br>22,700       | 千ブラジル・レアル<br>20,546       | 709,470       | 9.8      | －                   | 2.9               | 4.3      | 2.7      |



| 区 分   | 2017年11月30日現在           |                         |               |          |                 |                   |          |          |
|-------|-------------------------|-------------------------|---------------|----------|-----------------|-------------------|----------|----------|
|       | 額 面 金 額                 | 評 価 額                   |               | 組 入 比 率  | うちＢＢ格<br>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  |
| チェコ   | 千チェコ・コルナ<br>49,000      | 千チェコ・コルナ<br>53,132      | 千円<br>276,820 | %<br>3.8 | %<br>－          | %<br>2.1          | %<br>1.3 | %<br>0.4 |
| ルーマニア | 千ルーマニア・レイ<br>6,710      | 千ルーマニア・レイ<br>6,857      | 196,194       | 2.7      | －               | 1.2               | 1.0      | 0.5      |
| ロシア   | 千ロシア・ルーブル<br>273,640    | 千ロシア・ルーブル<br>275,871    | 526,914       | 7.3      | －               | 4.7               | 1.9      | 0.6      |
| マレーシア | 千マレーシア・リンギット<br>14,810  | 千マレーシア・リンギット<br>14,802  | 405,882       | 5.6      | －               | 2.9               | 1.8      | 0.9      |
| 南アフリカ | 千南アフリカ・ランド<br>76,260    | 千南アフリカ・ランド<br>67,754    | 555,586       | 7.6      | －               | 6.6               | 0.9      | 0.1      |
| タイ    | 千タイ・バーツ<br>151,060      | 千タイ・バーツ<br>163,205      | 561,425       | 7.7      | －               | 4.4               | 2.4      | 0.9      |
| ペルー   | 千ペルー・ソル<br>4,960        | 千ペルー・ソル<br>5,522        | 191,232       | 2.6      | －               | 2.5               | 0.2      | －        |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ<br>20,360    | 千ポーランド・ズロチ<br>20,614    | 651,429       | 9.0      | －               | 2.9               | 4.7      | 1.3      |
| ハンガリー | 千ハンガリー・フォリント<br>657,400 | 千ハンガリー・フォリント<br>756,943 | 322,003       | 4.4      | －               | 1.9               | 1.9      | 0.7      |
| ウルグアイ | 千ウルグアイ・ペソ<br>5,100      | 千ウルグアイ・ペソ<br>5,261      | 20,363        | 0.3      | －               | 0.1               | 0.1      | －        |
| 合 計   | －                       | －                       | 7,007,813     | 96.5     | 1.0             | 54.2              | 32.0     | 10.2     |

(注1) 邦貨換算金額は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

## (2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

| 2017年11月30日現在 |                        |         |         |         |           |             |            |  |
|---------------|------------------------|---------|---------|---------|-----------|-------------|------------|--|
| 区 分           | 銘 柄                    | 種 類     | 年 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額     |             | 償 還 年 月 日  |  |
|               |                        |         |         |         | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |  |
| トルコ           |                        |         | %       | 千トルコ・リラ | 千トルコ・リラ   | 千円          |            |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 10.5000 | 680     | 643       | 18,209      | 2020/01/15 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 9.5000  | 510     | 452       | 12,806      | 2022/01/12 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 8.5000  | 790     | 670       | 18,971      | 2022/09/14 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 7.1000  | 780     | 613       | 17,378      | 2023/03/08 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 8.8000  | 790     | 665       | 18,853      | 2023/09/27 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 10.4000 | 470     | 453       | 12,843      | 2019/03/27 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 10.4000 | 680     | 622       | 17,614      | 2024/03/20 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 8.5000  | 1,160   | 1,082     | 30,655      | 2019/07/10 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 9.0000  | 630     | 538       | 15,231      | 2024/07/24 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 7.4000  | 770     | 682       | 19,335      | 2020/02/05 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 8.0000  | 1,490   | 1,184     | 33,545      | 2025/03/12 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 9.4000  | 1,180   | 1,074     | 30,432      | 2020/07/08 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 10.7000 | 910     | 845       | 23,932      | 2021/02/17 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 10.6000 | 1,570   | 1,434     | 40,602      | 2026/02/11 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 9.2000  | 1,010   | 885       | 25,076      | 2021/09/22 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 11.0000 | 1,400   | 1,307     | 37,018      | 2022/03/02 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 11.0000 | 1,470   | 1,365     | 38,660      | 2027/02/24 |  |
|               | Turkey Government Bond | 国 債 証 券 | 10.7000 | 700     | 642       | 18,192      | 2022/08/17 |  |

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

| 2017年11月30日現在 |              |                                          |         |              |                     |                      |              |            |
|---------------|--------------|------------------------------------------|---------|--------------|---------------------|----------------------|--------------|------------|
| 区 分           |              | 銘 柄                                      | 種 類     | 年 利 率        | 額 面 金 額             | 評 価 額                |              | 償 還 年 月 日  |
|               |              |                                          |         |              |                     | 外 貨 建 金 額            | 邦 貨 換 算 金 額  |            |
|               |              | Turkey Government Bond                   | 国 債 証 券 | %<br>10.5000 | 千トルコ・リラ<br>1,000    | 千トルコ・リラ<br>900       | 千円<br>25,499 | 2027/08/11 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額 | 19銘柄                                     |         |              | 17,990              | 16,067               | 454,859      |            |
| メキシコ          |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 5.0000       | 千メキシコ・ペソ<br>9,800   | 千メキシコ・ペソ<br>9,421    | 56,812       | 2019/12/11 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 5.7500       | 5,900               | 5,371                | 32,390       | 2026/03/05 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 8.0000       | 4,500               | 4,729                | 28,521       | 2047/11/07 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 8.0000       | 4,250               | 4,430                | 26,715       | 2023/12/07 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 10.0000      | 11,350              | 13,137               | 79,216       | 2024/12/05 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 7.5000       | 5,230               | 5,317                | 32,065       | 2027/06/03 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 10.0000      | 4,390               | 5,492                | 33,118       | 2036/11/20 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 8.5000       | 4,230               | 4,618                | 27,846       | 2029/05/31 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 8.5000       | 6,900               | 6,989                | 42,148       | 2018/12/13 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 8.5000       | 4,100               | 4,518                | 27,247       | 2038/11/18 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 8.0000       | 11,990              | 12,253               | 73,885       | 2020/06/11 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 6.5000       | 11,950              | 11,729               | 70,727       | 2021/06/10 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 7.7500       | 4,950               | 5,110                | 30,817       | 2031/05/29 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 6.5000       | 10,450              | 10,204               | 61,533       | 2022/06/09 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 7.7500       | 7,820               | 7,995                | 48,212       | 2042/11/13 |
|               |              | Mexican Bonos                            | 国 債 証 券 | 7.7500       | 4,130               | 4,247                | 25,615       | 2034/11/23 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額 | 16銘柄                                     |         |              | 111,940             | 115,567              | 696,874      |            |
| フィリピン         |              | Philippine Government International Bond | 国 債 証 券 | 4.9500       | 千フィリピン・ペソ<br>10,000 | 千フィリピン・ペソ<br>10,312  | 22,996       | 2021/01/15 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額 | 1銘柄                                      |         |              | 10,000              | 10,312               | 22,996       |            |
| アルゼンチン        |              | REPUBLIC OF ARGENTINA                    | 国 債 証 券 | 18.2000      | 千アルゼンチン・ペソ<br>4,700 | 千アルゼンチン・ペソ<br>4,814  | 30,958       | 2021/10/03 |
|               |              | REPUBLIC OF ARGENTINA                    | 国 債 証 券 | 16.0000      | 1,400               | 1,379                | 8,870        | 2023/10/17 |
|               |              | REPUBLIC OF ARGENTINA                    | 国 債 証 券 | 15.5000      | 5,000               | 5,067                | 32,585       | 2026/10/17 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額 | 3銘柄                                      |         |              | 11,100              | 11,262               | 72,415       |            |
| チリ            |              | BONOS TESORERIA PESOS                    | 国 債 証 券 | 4.5000       | 千チリ・ペソ<br>225,000   | 千チリ・ペソ<br>230,078    | 40,033       | 2021/03/01 |
|               |              | BONOS TESORERIA PESOS                    | 国 債 証 券 | 4.5000       | 320,000             | 318,774              | 55,466       | 2026/03/01 |
|               |              | BONOS TESORERIA PESOS                    | 国 債 証 券 | 5.0000       | 250,000             | 249,487              | 43,410       | 2035/03/01 |
|               |              | BONOS TESORERIA PESOS                    | 国 債 証 券 | 6.0000       | 130,000             | 143,529              | 24,974       | 2043/01/01 |
|               |              | Chile Government International Bond      | 国 債 証 券 | 5.5000       | 50,000              | 52,666               | 9,163        | 2020/08/05 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額 | 5銘柄                                      |         |              | 975,000             | 994,535              | 173,049      |            |
| コロンビア         |              | Colombia Government International Bond   | 国 債 証 券 | 9.8500       | 千コロンビア・ペソ<br>90,000 | 千コロンビア・ペソ<br>113,270 | 4,224        | 2027/06/28 |
|               |              | Colombia Government International Bond   | 国 債 証 券 | 7.7500       | 95,000              | 101,641              | 3,791        | 2021/04/14 |
|               |              | Colombia Government International Bond   | 国 債 証 券 | 4.3750       | 45,000              | 42,741               | 1,594        | 2023/03/21 |
|               |              | Colombian TES                            | 国 債 証 券 | 7.0000       | 935,000             | 969,856              | 36,175       | 2019/09/11 |
|               |              | Colombian TES                            | 国 債 証 券 | 11.0000      | 1,465,000           | 1,675,579            | 62,499       | 2020/07/24 |
|               |              | Colombian TES                            | 国 債 証 券 | 7.0000       | 2,105,000           | 2,220,480            | 82,823       | 2022/05/04 |
|               |              | Colombian TES                            | 国 債 証 券 | 10.0000      | 2,100,000           | 2,537,640            | 94,653       | 2024/07/24 |
|               |              | Colombian TES                            | 国 債 証 券 | 6.0000       | 940,000             | 898,367              | 33,509       | 2028/04/28 |
|               |              | Colombian TES                            | 国 債 証 券 | 7.5000       | 2,510,000           | 2,693,179            | 100,455      | 2026/08/26 |
|               |              | Colombian TES                            | 国 債 証 券 | 7.7500       | 1,240,000           | 1,350,744            | 50,382       | 2030/09/18 |
|               |              | Colombian TES                            | 国 債 証 券 | 7.0000       | 350,000             | 355,694              | 13,267       | 2032/06/30 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額 | 11銘柄                                     |         |              | 11,875,000          | 12,959,195           | 483,377      |            |

| 2017年11月30日現在 |                                          |         |         |            |             |             |            |  |
|---------------|------------------------------------------|---------|---------|------------|-------------|-------------|------------|--|
| 区 分           | 銘 柄                                      | 種 類     | 年 利 率   | 額 面 金 額    | 評 価 額       |             | 償 還 年 月 日  |  |
|               |                                          |         |         |            | 外 貨 建 金 額   | 邦 貨 換 算 金 額 |            |  |
| インドネシア        | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 8.2500  | 5,750,000  | 千インドネシア・ルピア | 千円          | 2036/05/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 8.7500  | 4,000,000  | 6,334,602   | 52,577      | 2031/05/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 7.5000  | 2,800,000  | 4,597,880   | 38,162      | 2032/08/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 11.0000 | 2,400,000  | 2,919,168   | 24,229      | 2020/11/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 12.8000 | 600,000    | 2,723,760   | 22,607      | 2021/06/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 11.0000 | 1,700,000  | 727,278     | 6,036       | 2025/09/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 10.5000 | 2,180,000  | 2,150,874   | 17,852      | 2030/08/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 8.2500  | 5,710,000  | 2,803,501   | 23,269      | 2021/07/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 9.5000  | 1,270,000  | 6,121,177   | 50,805      | 2031/07/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 8.3750  | 6,324,000  | 1,522,044   | 12,632      | 2026/09/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 8.2500  | 4,750,000  | 7,067,892   | 58,663      | 2032/06/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 7.0000  | 5,330,000  | 5,208,802   | 43,233      | 2027/05/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 7.0000  | 4,460,000  | 5,514,151   | 45,767      | 2022/05/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 5.6250  | 1,410,000  | 4,625,956   | 38,395      | 2023/05/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 6.1250  | 1,200,000  | 1,366,106   | 11,338      | 2028/05/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 6.6250  | 1,975,000  | 1,147,128   | 9,521       | 2033/05/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 8.3750  | 4,720,000  | 1,881,187   | 15,613      | 2034/03/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 8.3750  | 9,150,000  | 5,203,469   | 43,188      | 2024/03/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 9.0000  | 5,820,000  | 10,062,163  | 83,515      | 2029/03/15 |  |
|               | Indonesia Treasury Bond                  | 国 債 証 券 | 7.8750  | 3,900,000  | 6,761,850   | 56,123      | 2019/04/15 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額                             | 20銘柄    |         | 75,449,000 | 82,760,869  | 686,915     |            |  |
| 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  | 千ブラジル・レアル   |             | 2021/01/01 |  |
|               | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国 債 証 券 | 10.0000 | 2,180      | 2,228       | 76,954      | 2023/01/01 |  |
|               | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国 債 証 券 | 10.0000 | 280        | 288         | 9,950       | 2019/01/01 |  |
|               | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国 債 証 券 | 10.0000 | 1,690      | 1,676       | 57,899      | 2025/01/01 |  |
|               | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国 債 証 券 | 10.0000 | 1,500      | 1,477       | 51,026      | 2027/01/01 |  |
|               | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国 債 証 券 | —       | 2,370      | 2,202       | 76,035      | 2019/01/01 |  |
|               | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国 債 証 券 | —       | 1,510      | 1,343       | 46,393      | 2019/07/01 |  |
|               | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国 債 証 券 | —       | 2,050      | 1,733       | 59,847      | 2020/01/01 |  |
|               | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国 債 証 券 | —       | 5,040      | 4,046       | 139,717     | 2020/07/01 |  |
|               | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国 債 証 券 | —       | 1,920      | 1,747       | 60,347      | 2019/04/01 |  |
|               | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国 債 証 券 | —       | 1,330      | 959         | 33,132      | 2021/07/01 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額                             | 11銘柄    |         | 22,700     | 20,546      | 709,470     |            |  |
| チェコ           | Czech Republic Government Bond           | 国 債 証 券 | 3.7500  | 千チェコ・コルナ   | 千チェコ・コルナ    |             | 2020/09/12 |  |
|               | Czech Republic Government Bond           | 国 債 証 券 | 3.8500  | 6,500      | 7,098       | 36,983      | 2021/09/29 |  |
|               | Czech Republic Government Bond           | 国 債 証 券 | 2.5000  | 5,200      | 5,862       | 30,543      | 2028/08/25 |  |
|               | Czech Republic Government Bond           | 国 債 証 券 | 5.7000  | 6,600      | 7,086       | 36,920      | 2024/05/25 |  |
|               | Czech Republic Government Bond           | 国 債 証 券 | 1.5000  | 5,600      | 7,239       | 37,716      | 2019/10/29 |  |
|               | Czech Republic Government Bond           | 国 債 証 券 | 4.7000  | 6,000      | 6,125       | 31,911      | 2022/09/12 |  |
|               | Czech Republic Government Bond           | 国 債 証 券 | 2.4000  | 3,000      | 3,551       | 18,500      | 2025/09/17 |  |
|               | Czech Republic Government Bond           | 国 債 証 券 | 1.0000  | 6,100      | 6,612       | 34,450      | 2026/06/26 |  |
|               | Czech Republic Government Bond           | 国 債 証 券 | 0.9500  | 3,200      | 3,083       | 16,064      | 2030/05/15 |  |
|               | Czech Republic Government Bond           | 国 債 証 券 | —       | 2,000      | 1,787       | 9,311       | 2020/10/20 |  |
|               | Czech Republic Government Bond           | 国 債 証 券 | —       | 1,900      | 1,873       | 9,759       | 2023/10/25 |  |
|               | Czech Republic Government Bond           | 国 債 証 券 | 0.4500  | 2,900      | 2,813       | 14,657      |            |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額                             | 11銘柄    |         | 49,000     | 53,132      | 276,820     |            |  |
| ルーマニア         | Romania Government Bond                  | 国 債 証 券 | 5.8500  | 千ルーマニア・レイ  | 千ルーマニア・レイ   |             | 2023/04/26 |  |
|               | Romania Government Bond                  | 国 債 証 券 | 4.7500  | 430        | 466         | 24,115      | 2019/06/24 |  |
|               | Romania Government Bond                  | 国 債 証 券 | 5.9500  | 820        | 842         | 13,505      | 2021/06/11 |  |

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

| 2017年11月30日現在              |              |                                      |         |        |              |              |             |            |  |
|----------------------------|--------------|--------------------------------------|---------|--------|--------------|--------------|-------------|------------|--|
| 区 分                        |              | 銘 柄                                  | 種 類     | 年 利 率  | 額 面 金 額      | 評 価 額        |             | 償 還 年 月 日  |  |
|                            |              |                                      |         |        |              | 外 貨 建 金 額    | 邦 貨 換 算 金 額 |            |  |
|                            |              |                                      |         | %      | 千ルーマニア・レイ    | 千ルーマニア・レイ    | 千円          |            |  |
|                            |              | Romania Government Bond              | 国 債 証 券 | 5.7500 | 770          | 814          | 23,294      | 2020/04/29 |  |
|                            |              | Romania Government Bond              | 国 債 証 券 | 4.7500 | 580          | 596          | 17,057      | 2025/02/24 |  |
|                            |              | Romania Government Bond              | 国 債 証 券 | 2.5000 | 360          | 358          | 10,262      | 2019/04/29 |  |
|                            |              | Romania Government Bond              | 国 債 証 券 | 3.2500 | 630          | 622          | 17,806      | 2021/03/22 |  |
|                            |              | Romania Government Bond              | 国 債 証 券 | 5.8000 | 700          | 769          | 22,007      | 2027/07/26 |  |
|                            |              | Romania Government Bond              | 国 債 証 券 | 2.2500 | 700          | 687          | 19,664      | 2020/02/26 |  |
|                            |              | Romania Government Bond              | 国 債 証 券 | 3.5000 | 480          | 469          | 13,424      | 2022/12/19 |  |
|                            |              | Romania Government Bond              | 国 債 証 券 | 3.2500 | 800          | 759          | 21,720      | 2024/04/29 |  |
| 通貨小計                       | 銘 柄 数<br>金 額 | 11銘柄                                 |         |        | 6,710        | 6,857        | 196,194     |            |  |
|                            |              |                                      |         |        | 千ロシア・ルーブル    | 千ロシア・ルーブル    |             |            |  |
| ロシア                        |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 7.6000 | 14,880       | 15,077       | 28,797      | 2021/04/14 |  |
|                            |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 7.5000 | 7,130        | 7,160        | 13,677      | 2019/02/27 |  |
|                            |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 8.1500 | 23,760       | 24,880       | 47,521      | 2027/02/03 |  |
|                            |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 7.6000 | 11,910       | 12,085       | 23,083      | 2022/07/20 |  |
|                            |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 6.8000 | 10,800       | 10,737       | 20,509      | 2019/12/11 |  |
|                            |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 7.0000 | 8,400        | 8,289        | 15,833      | 2023/01/25 |  |
|                            |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 7.0500 | 16,660       | 16,131       | 30,810      | 2028/01/19 |  |
|                            |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 6.4000 | 14,100       | 13,856       | 26,466      | 2020/05/27 |  |
|                            |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 6.7000 | 15,700       | 15,613       | 29,822      | 2019/05/15 |  |
|                            |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 7.0000 | 24,300       | 23,961       | 45,767      | 2023/08/16 |  |
|                            |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 7.5000 | 21,300       | 21,513       | 41,089      | 2021/08/18 |  |
|                            |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 8.5000 | 17,000       | 18,385       | 35,116      | 2031/09/17 |  |
|                            |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 7.7500 | 24,100       | 24,663       | 47,108      | 2026/09/16 |  |
|                            |              | Russian Federal Bond - OFZ           | 国 債 証 券 | 7.4000 | 21,000       | 21,119       | 40,339      | 2022/12/07 |  |
| Russian Federal Bond - OFZ | 国 債 証 券      | 7.7000                               | 27,000  | 27,020 | 51,608       | 2033/03/23   |             |            |  |
| Russian Federal Bond - OFZ | 国 債 証 券      | 7.1000                               | 15,600  | 15,373 | 29,363       | 2024/10/16   |             |            |  |
| 通貨小計                       | 銘 柄 数<br>金 額 | 16銘柄                                 |         |        | 273,640      | 275,871      | 526,914     |            |  |
|                            |              |                                      |         |        | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット |             |            |  |
| マレーシア                      |              | Malaysia Government Investment Issue | 国 債 証 券 | 4.3900 | 600          | 612          | 16,786      | 2023/07/07 |  |
|                            |              | Malaysia Government Investment Issue | 国 債 証 券 | 3.2260 | 530          | 527          | 14,458      | 2020/04/15 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 4.3780 | 970          | 992          | 27,221      | 2019/11/29 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 4.1600 | 920          | 940          | 25,786      | 2021/07/15 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 4.2320 | 940          | 914          | 25,075      | 2031/06/30 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 3.4180 | 740          | 728          | 19,967      | 2022/08/15 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 3.4920 | 910          | 915          | 25,107      | 2020/03/31 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 3.4800 | 860          | 843          | 23,135      | 2023/03/15 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 4.1810 | 740          | 748          | 20,513      | 2024/07/15 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 3.6540 | 910          | 918          | 25,197      | 2019/10/31 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 3.9550 | 920          | 910          | 24,969      | 2025/09/15 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 3.6590 | 1,040        | 1,047        | 28,717      | 2020/10/15 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 4.2540 | 400          | 384          | 10,555      | 2035/05/31 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 3.7590 | 380          | 384          | 10,534      | 2019/03/15 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 3.8000 | 900          | 894          | 24,523      | 2023/08/17 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 3.9000 | 800          | 785          | 21,528      | 2026/11/30 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 3.6200 | 600          | 600          | 16,470      | 2021/11/30 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 4.0590 | 920          | 927          | 25,418      | 2024/09/30 |  |
|                            |              | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国 債 証 券 | 3.8990 | 730          | 726          | 19,916      | 2027/11/16 |  |
| 通貨小計                       | 銘 柄 数<br>金 額 | 19銘柄                                 |         |        | 14,810       | 14,802       | 405,882     |            |  |
|                            |              |                                      |         |        | 千南アフリカ・ランド   | 千南アフリカ・ランド   |             |            |  |
| 南アフリカ                      |              | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA             | 国 債 証 券 | 8.0000 | 1,120        | 1,125        | 9,230       | 2018/12/21 |  |
|                            |              | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA             | 国 債 証 券 | 7.2500 | 4,190        | 4,128        | 33,851      | 2020/01/15 |  |

| 2017年11月30日現在 |                          |         |         |            |            |             |            |  |
|---------------|--------------------------|---------|---------|------------|------------|-------------|------------|--|
| 区 分           | 銘 柄                      | 種 類     | 年 利 率   | 額 面 金 額    | 評 価 額      |             | 償 還 年 月 日  |  |
|               |                          |         |         |            | 外 貨 建 金 額  | 邦 貨 換 算 金 額 |            |  |
|               |                          |         | %       | 千南アフリカ・ランド | 千南アフリカ・ランド | 千円          |            |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 10.5000 | 10,450     | 11,205     | 91,885      | 2026/12/21 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 6.2500  | 3,220      | 2,212      | 18,139      | 2036/03/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 6.7500  | 3,760      | 3,593      | 29,469      | 2021/03/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 6.5000  | 5,280      | 3,562      | 29,211      | 2041/02/28 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 7.0000  | 5,440      | 4,336      | 35,555      | 2031/02/28 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 7.7500  | 2,980      | 2,873      | 23,558      | 2023/02/28 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.7500  | 8,320      | 7,145      | 58,594      | 2048/02/28 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.5000  | 6,000      | 5,160      | 42,319      | 2037/01/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.0000  | 5,700      | 4,993      | 40,948      | 2030/01/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.7500  | 4,900      | 4,205      | 34,486      | 2044/01/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.2500  | 5,300      | 4,623      | 37,915      | 2032/03/31 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 8.8750  | 5,100      | 4,594      | 37,673      | 2035/02/28 |  |
|               | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国 債 証 券 | 9.0000  | 4,500      | 3,993      | 32,745      | 2040/01/31 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額             | 15銘柄    |         | 76,260     | 67,754     | 555,586     |            |  |
| タイ            |                          |         |         | 千タイ・バーツ    | 千タイ・バーツ    |             |            |  |
|               | Thailand Government Bond | 国 債 証 券 | 3.8750  | 18,300     | 18,985     | 65,310      | 2019/06/13 |  |
|               | Thailand Government Bond | 国 債 証 券 | 4.8750  | 19,050     | 23,437     | 80,624      | 2029/06/22 |  |
|               | Thailand Government Bond | 国 債 証 券 | 3.6250  | 15,300     | 16,632     | 57,216      | 2023/06/16 |  |
|               | Thailand Government Bond | 国 債 証 券 | 3.8500  | 16,610     | 18,566     | 63,868      | 2025/12/12 |  |
|               | Thailand Government Bond | 国 債 証 券 | 3.6500  | 22,100     | 23,771     | 81,773      | 2021/12/17 |  |
|               | Thailand Government Bond | 国 債 証 券 | 3.6500  | 10,700     | 11,813     | 40,637      | 2031/06/20 |  |
|               | Thailand Government Bond | 国 債 証 券 | 2.5500  | 13,000     | 13,329     | 45,853      | 2020/06/26 |  |
|               | Thailand Government Bond | 国 債 証 券 | 1.8750  | 13,500     | 13,540     | 46,578      | 2022/06/17 |  |
|               | Thailand Government Bond | 国 債 証 券 | 3.4000  | 10,100     | 10,820     | 37,221      | 2036/06/17 |  |
|               | Thailand Government Bond | 国 債 証 券 | 2.1250  | 7,400      | 7,283      | 25,055      | 2026/12/17 |  |
|               | Thailand Government Bond | 国 債 証 券 | 2.0000  | 5,000      | 5,024      | 17,284      | 2022/12/17 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額             | 11銘柄    |         | 151,060    | 163,205    | 561,425     |            |  |
| ペルー           |                          |         |         | 千ペルー・ソル    | 千ペルー・ソル    |             |            |  |
|               | Peru Government Bond     | 国 債 証 券 | 5.7000  | 580        | 618        | 21,434      | 2024/08/12 |  |
|               | Peru Government Bond     | 国 債 証 券 | 6.3500  | 970        | 1,054      | 36,514      | 2028/08/12 |  |
|               | Peru Government Bond     | 国 債 証 券 | 6.1500  | 950        | 1,012      | 35,078      | 2032/08/12 |  |
|               | Peru Government Bond     | 国 債 証 券 | 8.2000  | 715        | 873        | 30,245      | 2026/08/12 |  |
|               | Peru Government Bond     | 国 債 証 券 | 7.8400  | 310        | 343        | 11,885      | 2020/08/12 |  |
|               | Peru Government Bond     | 国 債 証 券 | 6.9000  | 665        | 738        | 25,575      | 2037/08/12 |  |
|               | Peru Government Bond     | 国 債 証 券 | 6.9500  | 770        | 880        | 30,497      | 2031/08/12 |  |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額             | 7銘柄     |         | 4,960      | 5,522      | 191,232     |            |  |
| ポーランド         |                          |         |         | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ |             |            |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 5.7500  | 1,210      | 1,382      | 43,688      | 2022/09/23 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 5.5000  | 880        | 945        | 29,863      | 2019/10/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 1.5000  | 2,210      | 2,195      | 69,389      | 2020/04/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 2.5000  | 2,040      | 1,928      | 60,934      | 2026/07/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 2.0000  | 1,560      | 1,551      | 49,024      | 2021/04/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 1.7500  | 2,230      | 2,192      | 69,277      | 2021/07/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 2.5000  | 1,690      | 1,575      | 49,793      | 2027/07/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 2.2500  | 1,650      | 1,633      | 51,602      | 2022/04/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | —       | 830        | 813        | 25,715      | 2019/04/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 5.2500  | 920        | 1,005      | 31,787      | 2020/10/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 5.7500  | 820        | 926        | 29,262      | 2021/10/25 |  |
|               | Poland Government Bond   | 国 債 証 券 | 4.0000  | 1,530      | 1,627      | 51,444      | 2023/10/25 |  |

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

| 2017年11月30日現在 |              |                                       |         |        |              |              |             |            |
|---------------|--------------|---------------------------------------|---------|--------|--------------|--------------|-------------|------------|
| 区 分           |              | 銘 柄                                   | 種 類     | 年 利 率  | 額 面 金 額      | 評 価 額        |             | 償 還 年 月 日  |
|               |              |                                       |         |        |              | 外 貨 建 金 額    | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
|               |              | Poland Government Bond                | 国 債 証 券 | %      | 千ポーランド・ズロチ   | 千ポーランド・ズロチ   | 千円          |            |
|               |              | Poland Government Bond                | 国 債 証 券 | 3.2500 | 1,250        | 1,286        | 40,653      | 2019/07/25 |
|               |              |                                       |         | 3.2500 | 1,540        | 1,550        | 48,992      | 2025/07/25 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額 | 14銘柄                                  |         |        | 20,360       | 20,614       | 651,429     |            |
| ハンガリー         |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 3.5000 | 千ハンガリー・フォリント | 千ハンガリー・フォリント |             |            |
|               |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 3.0000 | 66,300       | 71,652       | 30,480      | 2020/06/24 |
|               |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 3.0000 | 70,500       | 76,974       | 32,744      | 2024/06/26 |
|               |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 3.0000 | 58,000       | 62,661       | 26,656      | 2027/10/27 |
|               |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 2.0000 | 23,000       | 23,865       | 10,152      | 2019/10/30 |
|               |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 2.5000 | 39,000       | 41,389       | 17,607      | 2021/10/27 |
|               |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 1.0000 | 14,000       | 14,191       | 6,037       | 2020/09/23 |
|               |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 1.7500 | 20,000       | 20,671       | 8,793       | 2022/10/26 |
|               |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 7.5000 | 59,500       | 71,563       | 30,443      | 2020/11/12 |
|               |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 6.0000 | 81,800       | 103,943      | 44,217      | 2023/11/24 |
|               |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 6.5000 | 58,800       | 64,721       | 27,532      | 2019/06/24 |
|               |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 7.0000 | 80,000       | 101,364      | 43,120      | 2022/06/24 |
|               |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 5.5000 | 24,000       | 25,386       | 10,799      | 2018/12/20 |
|               |              | Hungary Government Bond               | 国 債 証 券 | 5.5000 | 62,500       | 78,559       | 33,419      | 2025/06/24 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額 | 13銘柄                                  |         |        | 657,400      | 756,943      | 322,003     |            |
| ウルグアイ         |              | Uruguay Government International Bond | 国 債 証 券 | 9.8750 | 千ウルグアイ・ペソ    | 千ウルグアイ・ペソ    |             |            |
|               |              | Uruguay Government International Bond | 国 債 証 券 | 8.5000 | 2,300        | 2,452        | 9,489       | 2022/06/20 |
|               |              |                                       |         |        | 2,800        | 2,809        | 10,874      | 2028/03/15 |
| 通貨小計          | 銘 柄 数<br>金 額 | 2銘柄                                   |         |        | 5,100        | 5,261        | 20,363      |            |
| 合 計           | 銘 柄 数<br>金 額 | 205銘柄                                 |         |        |              |              | 7,007,813   |            |

(注1) 邦貨換算金額は、2017年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

# 外国債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第18期 (決算日 2017年11月30日)

(計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日)

外国債券インデックスマザーファンドの第18期にかかる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   | 投資成果をシティ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                                                                                                                                                                                       |
| 運用方法   | ①主として外国の公社債に投資し、投資成果をシティ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。<br>②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受け取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の30%以下                                                                                                                                                                                  |

## 大和投資信託

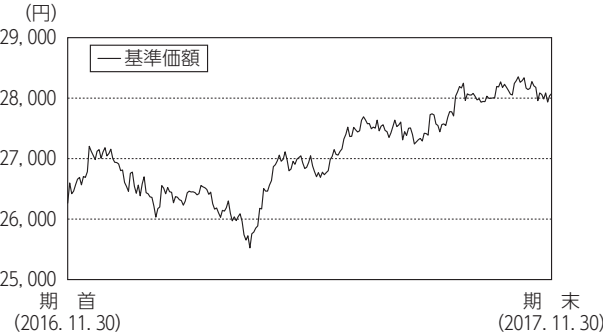
Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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



■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日            | 基 準 価 額 |          | シティ世界国債インデックス<br>(除く日本、ヘッジなし・<br>円ベース) | 公 社 債 債 券<br>組入比率 |       | 先物比率 |
|------------------|---------|----------|----------------------------------------|-------------------|-------|------|
|                  | 騰落率     | (ベンチマーク) | 騰落率                                    |                   |       |      |
|                  | 円       | %        |                                        | %                 | %     | %    |
| (期首) 2016年11月30日 | 26, 265 | —        | 26, 597                                | —                 | 98. 4 | —    |
| 12月末             | 27, 085 | 3. 1     | 27, 285                                | 2. 6              | 98. 6 | —    |
| 2017年 1 月末       | 26, 435 | 0. 6     | 26, 695                                | 0. 4              | 98. 3 | —    |
| 2 月末             | 26, 296 | 0. 1     | 26, 510                                | △ 0. 3            | 98. 4 | —    |
| 3 月末             | 26, 300 | 0. 1     | 26, 423                                | △ 0. 7            | 98. 4 | —    |
| 4 月末             | 26, 461 | 0. 7     | 26, 704                                | 0. 4              | 98. 8 | —    |
| 5 月末             | 26, 857 | 2. 3     | 27, 142                                | 2. 0              | 98. 5 | —    |
| 6 月末             | 27, 364 | 4. 2     | 27, 778                                | 4. 4              | 98. 6 | —    |
| 7 月末             | 27, 350 | 4. 1     | 27, 775                                | 4. 4              | 98. 6 | —    |
| 8 月末             | 27, 740 | 5. 6     | 27, 985                                | 5. 2              | 98. 4 | —    |
| 9 月末             | 28, 050 | 6. 8     | 28, 327                                | 6. 5              | 98. 7 | —    |
| 10 月末            | 28, 052 | 6. 8     | 28, 338                                | 6. 5              | 98. 6 | —    |
| (期末) 2017年11月30日 | 28, 075 | 6. 9     | 28, 323                                | 6. 5              | 98. 4 | —    |

(注 1) 騰落率は期首比。  
(注 2) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、Citigroup Index LLC が開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。  
(注 3) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) の原データをもとに、当ファンドの設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。  
(注 4) 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 5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。  
(注 6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について  
【基準価額・騰落率】  
期首：26,265円 期末：28,075円 騰落率：6.9%  
【基準価額の主な変動要因】  
主に日本を除く先進国国債に投資した結果、債券市場で金利は上昇 (債券価格は下落) したものの、ユーロなどの対円為替レートの上昇がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。  
◆投資環境について  
○海外債券市況  
主要国の国債金利は、期を通じて多くの国で上昇しました。期首より、上下に振れながらもおおむねレンジ内で推移しましたが、2017年3月中旬以降は、米国トランプ政権の政策に対する不透明感などから金利は低下基調となりました。6月下旬以降は、ECB (欧州中央銀行) やBOC (カナダ銀行) などが金融緩和姿勢を後退させる中で、ドイツやカナダなどを中心に金利が上昇しました。しかしその後、米国の政治動向の不透明感や地政学リスクの高まりなどから、金利は低下基調で推移しました。9月には、米国の2017年中の追加利上げ観測の高まりなどを背景に金利は上昇しましたが、その後は、金利はレンジ内での推移が続きました。  
○為替相場  
為替相場は、期を通じてユーロなどの欧州の通貨が対円で上昇しました。期首より、米国の利上げ観測などを受けて円安となりましたが、2017年に入ると、トランプ政権に対する期待感の後退や欧州の政治情勢の不透明感などから円高傾向となりました。4月半ばからは、フランス大統領選挙の結果を受けて、ユーロが上昇傾向となった一方で円は下落傾向となりました。5月にはいったん円高となる場面も見られましたが、6月中旬に入り先進各国の中央銀行が金融緩和姿勢を後退させる中で内外の金利差が拡大傾向となったことなどから、円は下落傾向となりました。7月以降は、地政学リスクの高まりなどから円高傾向となりました。9月以降は、米国の2017年中の追加利上げ観測の高まりなどを背景に円安が進んだ後、米国の低インフレへの懸念などから円高に転じました。

◆前期における「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 (シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)) 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  
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  
ベンチマーク (シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)) の騰落率は6.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は6.9%となりました。  
当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0.05%程度でした。ただし、これら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ています。

《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         | —円        |
| 有価証券取引税         | —         |
| その他費用<br>(保管費用) | 7<br>( 7) |
| 合 計             | 7         |

(注 1) 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、簡便法により算出した結果です。費用の項  
目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の項目の概  
要をご参照ください。

(注 2) 各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

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

|   |         |      | 買 付 額                           | 売 付 額                           |
|---|---------|------|---------------------------------|---------------------------------|
| 外 | アメリカ    | 国債証券 | 千アメリカ・ドル<br>142, 447<br>( — )   | 千アメリカ・ドル<br>108, 195<br>( — )   |
|   | カナダ     | 国債証券 | 千カナダ・ドル<br>11, 707<br>( — )     | 千カナダ・ドル<br>9, 089<br>( — )      |
|   | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリア・ドル<br>6, 963<br>( — )  | 千オーストラリア・ドル<br>3, 410<br>( — )  |
|   | シンガポール  | 国債証券 | 千シンガポール・ドル<br>1, 239<br>( — )   | 千シンガポール・ドル<br>1, 107<br>( — )   |
|   | イギリス    | 国債証券 | 千イギリス・ポンド<br>5, 106<br>( — )    | 千イギリス・ポンド<br>7, 409<br>( — )    |
|   | スイス     | 国債証券 | 千スイス・フラン<br>—<br>( — )          | 千スイス・フラン<br>627<br>( — )        |
|   | デンマーク   | 国債証券 | 千デンマーク・クローネ<br>5, 847<br>( — )  | 千デンマーク・クローネ<br>10, 152<br>( — ) |
|   | ノルウェー   | 国債証券 | 千ノルウェー・クローネ<br>4, 526<br>( — )  | 千ノルウェー・クローネ<br>—<br>( — )       |
|   | スウェーデン  | 国債証券 | 千スウェーデン・クローネ<br>5, 410<br>( — ) | 千スウェーデン・クローネ<br>1, 760<br>( — ) |

|   |                 |      | 買 付 額                           | 売 付 額                           |
|---|-----------------|------|---------------------------------|---------------------------------|
| 外 | メキシコ            | 国債証券 | 千メキシコ・ペソ<br>38, 113<br>( — )    | 千メキシコ・ペソ<br>32, 351<br>( — )    |
|   | マレーシア           | 国債証券 | 千マレーシア・リンギット<br>3, 609<br>( — ) | 千マレーシア・リンギット<br>3, 954<br>( — ) |
|   | 南アフリカ           | 国債証券 | 千南アフリカ・ランド<br>15, 299<br>( — )  | 千南アフリカ・ランド<br>3, 976<br>( — )   |
|   | ポーランド           | 国債証券 | 千ポーランド・ズロチ<br>7, 467<br>( — )   | 千ポーランド・ズロチ<br>6, 970<br>( — )   |
|   | ユーロ<br>(アイルランド) | 国債証券 | 千ユーロ<br>1, 150<br>( — )         | 千ユーロ<br>797<br>( — )            |
|   | ユーロ<br>(オランダ)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>2, 437<br>( — )         | 千ユーロ<br>4, 447<br>( — )         |
|   | ユーロ<br>(ベルギー)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>3, 292<br>( — )         | 千ユーロ<br>2, 793<br>( — )         |
|   | ユーロ<br>(フランス)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>15, 244<br>( — )        | 千ユーロ<br>10, 831<br>( — )        |
|   | ユーロ<br>(ドイツ)    | 国債証券 | 千ユーロ<br>11, 220<br>( — )        | 千ユーロ<br>13, 064<br>( — )        |
|   | ユーロ<br>(スペイン)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>10, 791<br>( — )        | 千ユーロ<br>8, 418<br>( — )         |
| 国 | ユーロ<br>(イタリア)   | 国債証券 | 千ユーロ<br>14, 662<br>( — )        | 千ユーロ<br>13, 153<br>( — )        |
|   | ユーロ<br>(フィンランド) | 国債証券 | 千ユーロ<br>570<br>( — )            | 千ユーロ<br>432<br>( — )            |
|   | ユーロ<br>(オーストリア) | 国債証券 | 千ユーロ<br>2, 661<br>( — )         | 千ユーロ<br>1, 802<br>( — )         |
|   | ユーロ<br>(ユーロ通貨計) | 国債証券 | 千ユーロ<br>62, 031<br>( — )        | 千ユーロ<br>55, 742<br>( — )        |

(注 1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注 2) ( ) 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注 3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄  
公 社 債

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

| 当                                                         |          | 期                                                        |          |
|-----------------------------------------------------------|----------|----------------------------------------------------------|----------|
| 買                                                         |          | 売                                                        |          |
| 付                                                         |          | 付                                                        |          |
| 銘 柄                                                       | 金 額      | 銘 柄                                                      | 金 額      |
|                                                           | 千円       |                                                          | 千円       |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2027/8/15   | 663, 832 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2018/4/30  | 479, 606 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.375% 2027/5/15  | 638, 990 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.625% 2018/4/30 | 469, 931 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2026/11/15     | 607, 595 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.5% 2018/2/15   | 441, 094 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.125% 2024/3/31  | 556, 076 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.875% 2018/5/31 | 439, 788 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3% 2047/2/15      | 467, 890 | United Kingdom Gilt (イギリス) 1.25% 2018/7/22               | 410, 942 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2020/5/15    | 448, 954 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2018/8/31   | 390, 206 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2019/5/31   | 447, 802 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2018/2/28  | 382, 530 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2027/2/15   | 446, 563 | FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4% 2018/4/25               | 379, 171 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2019/6/30   | 440, 296 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1% 2018/5/31     | 375, 037 |
| United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2046/11/15 | 405, 454 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 4% 2018/8/15     | 366, 817 |

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

■組入資産明細表

(1)外国 (外貨建) 公社債 (通貨別)

| 作 成 期   | 当                       |                         |              |       | 未                  |           |       |       |
|---------|-------------------------|-------------------------|--------------|-------|--------------------|-----------|-------|-------|
| 区 分     | 額 面 金 額                 | 評 価 額                   |              | 組入比率  | うちＢＢ格<br>以下組入<br>率 | 残存期間別組入比率 |       |       |
|         |                         | 外 貨 建 金 額               | 邦貨換算金額       |       |                    | 5 年以上     | 2 年以上 | 2 年未満 |
|         |                         |                         | 千円           | %     | %                  | %         | %     | %     |
| アメリカ    | 千アメリカ・ドル<br>626, 026    | 千アメリカ・ドル<br>632, 164    | 70, 834, 003 | 42. 5 | —                  | 17. 7     | 16. 6 | 8. 2  |
| カナダ     | 千カナダ・ドル<br>37, 381      | 千カナダ・ドル<br>40, 103      | 3, 492, 978  | 2. 1  | —                  | 0. 9      | 0. 7  | 0. 5  |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル<br>38, 134  | 千オーストラリア・ドル<br>41, 065  | 3, 485, 224  | 2. 1  | —                  | 1. 3      | 0. 5  | 0. 2  |
| シンガポール  | 千シンガポール・ドル<br>7, 117    | 千シンガポール・ドル<br>7, 446    | 619, 502     | 0. 4  | —                  | 0. 2      | 0. 1  | 0. 1  |
| イギリス    | 千イギリス・ポンド<br>60, 444    | 千イギリス・ポンド<br>75, 999    | 11, 425, 072 | 6. 9  | —                  | 5. 0      | 1. 5  | 0. 4  |
| スイス     | 千スイス・フラン<br>2, 187      | 千スイス・フラン<br>2, 587      | 294, 510     | 0. 2  | —                  | 0. 1      | 0. 1  | 0. 0  |
| デンマーク   | 千デンマーク・クローネ<br>48, 636  | 千デンマーク・クローネ<br>60, 118  | 1, 072, 508  | 0. 6  | —                  | 0. 4      | 0. 1  | 0. 1  |
| ノルウェー   | 千ノルウェー・クローネ<br>32, 577  | 千ノルウェー・クローネ<br>34, 557  | 469, 287     | 0. 3  | —                  | 0. 2      | 0. 1  | 0. 1  |
| スウェーデン  | 千スウェーデン・クローネ<br>50, 850 | 千スウェーデン・クローネ<br>57, 615 | 770, 894     | 0. 5  | —                  | 0. 2      | 0. 2  | 0. 1  |
| メキシコ    | 千メキシコ・ペソ<br>225, 127    | 千メキシコ・ペソ<br>231, 806    | 1, 397, 790  | 0. 8  | —                  | 0. 5      | 0. 3  | 0. 1  |
| マレーシア   | 千マレーシア・リンギット<br>26, 889 | 千マレーシア・リンギット<br>26, 874 | 736, 885     | 0. 4  | —                  | 0. 2      | 0. 1  | 0. 1  |
| 南アフリカ   | 千南アフリカ・ランド<br>116, 723  | 千南アフリカ・ランド<br>102, 959  | 844, 266     | 0. 5  | —                  | 0. 4      | 0. 0  | 0. 0  |
| ポーランド   | 千ポーランド・ズロチ<br>31, 917   | 千ポーランド・ズロチ<br>32, 731   | 1, 034, 302  | 0. 6  | —                  | 0. 2      | 0. 3  | 0. 1  |

| 作 成 期                 |         | 当 期       |         |             |                    | 未         |       |       |      |
|-----------------------|---------|-----------|---------|-------------|--------------------|-----------|-------|-------|------|
| 区 分                   | 額 面 金 額 | 評 価 額     |         | 組入比率        | うちＢＢ格<br>以下組入<br>比 | 残存期間別組入比率 |       |       |      |
|                       |         | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額  |             |                    | 5 年以上     | 2 年以上 | 2 年未満 |      |
|                       |         | 千ユーロ      | 千ユーロ    | 千円          | %                  | %         | %     | %     | %    |
| ユ<br>ー<br>ロ<br>区<br>分 | アイルランド  | 8,727     | 9,950   | 1,321,550   | 0.8                | —         | 0.5   | 0.2   | 0.1  |
|                       | オランダ    | 23,054    | 27,284  | 3,623,622   | 2.2                | —         | 1.4   | 0.6   | 0.2  |
|                       | ベルギー    | 26,235    | 32,088  | 4,261,666   | 2.6                | —         | 1.8   | 0.5   | 0.2  |
|                       | フランス    | 108,392   | 128,181 | 17,023,784  | 10.2               | —         | 6.4   | 2.6   | 1.3  |
|                       | ドイツ     | 76,126    | 89,437  | 11,878,234  | 7.1                | —         | 4.1   | 2.1   | 0.9  |
|                       | スペイン    | 61,672    | 71,965  | 9,557,727   | 5.7                | —         | 3.7   | 1.3   | 0.7  |
|                       | イタリア    | 107,051   | 123,182 | 16,359,857  | 9.8                | —         | 5.7   | 3.0   | 1.1  |
|                       | フィンランド  | 6,863     | 7,614   | 1,011,296   | 0.6                | —         | 0.4   | 0.2   | 0.0  |
|                       | オーストリア  | 16,667    | 19,652  | 2,610,004   | 1.6                | —         | 1.0   | 0.4   | 0.2  |
|                       | 小計      | 434,787   | 509,357 | 67,647,744  | 40.6               | —         | 24.9  | 10.9  | 4.8  |
| 合 計                   |         | —         | —       | 164,124,972 | 98.4               | —         | 52.3  | 31.4  | 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)

|      |                                  | 当 期  |        |          | 未         |         |            |
|------|----------------------------------|------|--------|----------|-----------|---------|------------|
| 区 分  | 銘 柄                              | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額  | 評 価 額     |         | 償還年月日      |
|      |                                  |      |        |          | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額  |            |
|      |                                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円      |            |
| アメリカ | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.7500 | 2,488    | 2,537     | 284,300 | 2018/11/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 3,161    | 3,200     | 358,642 | 2019/02/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 3,096    | 3,159     | 353,990 | 2019/05/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 2,621    | 2,704     | 303,007 | 2019/08/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.3750 | 4,020    | 4,144     | 464,391 | 2019/11/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 4,280    | 4,451     | 498,737 | 2020/02/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.5000 | 3,073    | 3,197     | 358,275 | 2020/05/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 2,854    | 2,913     | 326,410 | 2020/08/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 | 4,509    | 4,607     | 516,303 | 2020/11/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.6250 | 4,076    | 4,294     | 481,154 | 2021/02/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.1250 | 2,551    | 2,652     | 297,250 | 2021/05/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,534    | 2,548     | 285,519 | 2021/08/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 1,320    | 1,321     | 148,061 | 2018/10/31 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,153    | 2,154     | 241,448 | 2021/11/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,165    | 2,159     | 241,933 | 2018/11/30 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,861    | 1,855     | 207,872 | 2018/12/31 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 1,426    | 1,418     | 158,989 | 2019/01/31 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 3,224    | 3,223     | 361,191 | 2022/02/15 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,843    | 1,835     | 205,675 | 2019/02/28 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 300      | 299       | 33,521  | 2019/03/31 |
|      | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 559      | 555       | 62,231  | 2019/04/30 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 当   |                                  |      | 期      |          | 未         |         |            | 償還年月日 |
|-----|----------------------------------|------|--------|----------|-----------|---------|------------|-------|
| 区 分 | 銘 柄                              | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額  | 評 価 額     |         |            |       |
|     |                                  |      |        |          | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額  |            |       |
|     |                                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円      |            |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,459    | 2,429     | 272,194 | 2022/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 2,385    | 2,364     | 264,908 | 2019/05/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,368    | 1,352     | 151,570 | 2019/06/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,784    | 1,759     | 197,108 | 2019/07/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,543    | 2,494     | 279,509 | 2022/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,872    | 1,848     | 207,085 | 2019/08/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,215    | 2,185     | 244,845 | 2019/09/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 884      | 875       | 98,115  | 2019/10/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,168    | 3,099     | 347,331 | 2022/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,353    | 1,332     | 149,358 | 2019/11/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 1,894    | 1,868     | 209,419 | 2019/12/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,366    | 1,354     | 151,762 | 2020/01/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 4,350    | 4,323     | 484,444 | 2023/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 1,968    | 1,944     | 217,894 | 2020/02/29 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 1,160    | 1,142     | 127,997 | 2020/03/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 4,685    | 4,589     | 514,245 | 2023/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 1,451    | 1,427     | 159,992 | 2020/04/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,461    | 2,434     | 272,790 | 2020/05/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,131    | 2,133     | 239,103 | 2020/06/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,827    | 2,839     | 318,124 | 2020/07/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 2,768    | 2,817     | 315,653 | 2023/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 1,993    | 2,008     | 225,006 | 2020/08/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 1,885    | 1,892     | 212,103 | 2020/09/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 3,611    | 3,598     | 403,188 | 2018/10/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,345    | 2,337     | 261,934 | 2020/10/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 5,021    | 5,179     | 580,403 | 2023/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 2,638    | 2,627     | 294,420 | 2018/11/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,501    | 2,510     | 281,307 | 2020/11/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,026    | 2,022     | 226,604 | 2018/12/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 2,006    | 2,035     | 228,107 | 2020/12/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.7500 | 5,229    | 5,388     | 603,803 | 2024/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,185    | 2,180     | 244,273 | 2019/01/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 1,647    | 1,658     | 185,843 | 2021/01/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,373    | 2,367     | 265,291 | 2019/02/28 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 1,734    | 1,738     | 194,840 | 2021/02/28 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,383    | 2,380     | 266,700 | 2019/03/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,821    | 2,850     | 319,377 | 2021/03/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 5,412    | 5,495     | 615,789 | 2024/05/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,975    | 2,970     | 332,825 | 2019/04/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,407    | 2,430     | 272,379 | 2021/04/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,241    | 2,233     | 250,210 | 2019/05/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,732    | 2,736     | 306,668 | 2021/05/31 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,885    | 2,880     | 322,708 | 2019/06/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 3,485    | 3,504     | 392,688 | 2021/06/30 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8.8750 | 904      | 982       | 110,144 | 2019/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8.1250 | 724      | 801       | 89,815  | 2019/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8.7500 | 642      | 759       | 85,151  | 2020/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 8.0000 | 2,106    | 2,588     | 290,049 | 2021/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.2500 | 654      | 798       | 89,442  | 2023/08/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.0000 | 855      | 1,091     | 122,274 | 2026/02/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.5000 | 630      | 842       | 94,371  | 2026/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6.1250 | 709      | 944       | 105,829 | 2027/11/15 |       |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5.5000 | 700      | 904       | 101,379 | 2028/08/15 |       |

| 当   |                                  |      | 期       |          | 未         |        |          | 償還年月日      |
|-----|----------------------------------|------|---------|----------|-----------|--------|----------|------------|
| 区 分 | 銘 柄                              | 種 類  | 年利率     | 額 面 金 額  | 評 価 額     |        |          |            |
|     |                                  |      |         |          | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額 |          |            |
|     |                                  |      | %       | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円     |          |            |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5. 2500 | 738      |           | 939    | 105, 291 | 2028/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5. 2500 | 473      |           | 604    | 67, 717  | 2029/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 6. 2500 | 964      | 1, 358    |        | 152, 192 | 2030/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5. 3750 | 991      | 1, 318    |        | 147, 758 | 2031/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 5000 | 1, 626   | 2, 088    |        | 234, 032 | 2036/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 5. 0000 | 547      | 747       |        | 83, 772  | 2037/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 3750 | 548      | 696       |        | 78, 083  | 2038/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 5000 | 519      | 670       |        | 75, 118  | 2038/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 5000 | 849      | 961       |        | 107, 720 | 2039/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 2500 | 1, 121   | 1, 405    |        | 157, 509 | 2039/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 5000 | 760      | 985       |        | 110, 412 | 2039/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 3750 | 1, 210   | 1, 543    |        | 172, 970 | 2039/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 6250 | 1, 710   | 2, 254    |        | 252, 649 | 2040/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 3750 | 1, 478   | 1, 888    |        | 211, 566 | 2040/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 8750 | 1, 591   | 1, 898    |        | 212, 727 | 2040/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 2500 | 1, 469   | 1, 848    |        | 207, 101 | 2040/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 7500 | 1, 754   | 2, 360    |        | 264, 539 | 2041/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 4. 3750 | 1, 365   | 1, 750    |        | 196, 131 | 2041/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 7500 | 1, 367   | 1, 603    |        | 179, 701 | 2041/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 1250 | 1, 450   | 1, 541    |        | 172, 677 | 2041/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 1250 | 1, 623   | 1, 723    |        | 193, 150 | 2042/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 0000 | 1, 353   | 1, 406    |        | 157, 596 | 2042/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 7500 | 1, 731   | 1, 719    |        | 192, 668 | 2042/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 7500 | 2, 630   | 2, 609    |        | 292, 434 | 2042/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 1250 | 2, 026   | 2, 148    |        | 240, 686 | 2043/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 8750 | 3, 998   | 4, 054    |        | 454, 274 | 2043/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 6250 | 3, 064   | 3, 531    |        | 395, 701 | 2043/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 7500 | 3, 581   | 4, 214    |        | 472, 252 | 2043/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 6250 | 3, 617   | 4, 175    |        | 467, 816 | 2044/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 3750 | 3, 657   | 4, 050    |        | 453, 845 | 2044/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 6250 | 3, 326   | 3, 318    |        | 371, 862 | 2019/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 2500 | 2, 834   | 2, 861    |        | 320, 674 | 2021/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 3750 | 5, 162   | 5, 199    |        | 582, 647 | 2024/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 1250 | 3, 729   | 3, 955    |        | 443, 259 | 2044/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 6250 | 2, 989   | 2, 982    |        | 334, 143 | 2019/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 0000 | 1, 301   | 1, 301    |        | 145, 844 | 2021/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 7500 | 3, 404   | 3, 403    |        | 381, 357 | 2019/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 1250 | 3, 625   | 3, 642    |        | 408, 179 | 2021/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 5000 | 3, 190   | 3, 174    |        | 355, 663 | 2019/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 0000 | 2, 163   | 2, 163    |        | 242, 475 | 2021/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 2500 | 3, 921   | 3, 917    |        | 438, 970 | 2024/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3. 0000 | 3, 696   | 3, 832    |        | 429, 472 | 2044/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 8750 | 2, 886   | 2, 873    |        | 321, 998 | 2021/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 5000 | 4, 325   | 4, 302    |        | 482, 096 | 2019/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 1250 | 3, 169   | 3, 183    |        | 356, 719 | 2021/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 6250 | 2, 204   | 2, 196    |        | 246, 165 | 2019/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 2500 | 3, 963   | 3, 918    |        | 439, 058 | 2020/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 5000 | 2, 427   | 2, 376    |        | 266, 291 | 2022/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 0000 | 5, 743   | 5, 636    |        | 631, 533 | 2025/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2. 5000 | 3, 763   | 3, 535    |        | 396, 176 | 2045/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 3750 | 2, 788   | 2, 762    |        | 309, 502 | 2020/02/29 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 7500 | 1, 809   | 1, 788    |        | 200, 432 | 2022/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1. 3750 | 2, 792   | 2, 764    |        | 309, 787 | 2020/03/31 |



外国債券インデックスマザーファンド

| 当 期 |                                  |      |        | 未 評 価 額  |           |         | 償還年月日      |
|-----|----------------------------------|------|--------|----------|-----------|---------|------------|
| 区 分 | 銘 柄                              | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額  | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額  |            |
|     |                                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円      |            |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,891    | 2,856     | 320,062 | 2022/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 5,788    | 5,722     | 641,249 | 2025/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 3,835    | 3,974     | 445,288 | 2045/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,607    | 2,579     | 289,055 | 2020/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,612    | 2,578     | 288,969 | 2022/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,826    | 2,806     | 314,424 | 2022/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 3,013    | 2,988     | 334,915 | 2020/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,001    | 2,985     | 334,553 | 2020/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,821    | 2,828     | 316,883 | 2022/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,135    | 3,118     | 349,379 | 2020/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,179    | 2,172     | 243,412 | 2022/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 5,743    | 5,617     | 629,423 | 2025/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 3,573    | 3,615     | 405,074 | 2045/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,445    | 2,422     | 271,455 | 2022/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,868    | 2,832     | 317,364 | 2020/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,472    | 2,433     | 272,702 | 2022/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,876    | 2,838     | 318,050 | 2020/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 5,840    | 5,809     | 650,943 | 2025/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 3,116    | 3,072     | 344,291 | 2020/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 3,709    | 3,842     | 430,525 | 2045/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,558    | 2,532     | 283,711 | 2022/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 2,138    | 2,130     | 238,690 | 2018/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 3,096    | 3,073     | 344,357 | 2020/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,687    | 2,675     | 299,783 | 2022/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 2,151    | 2,142     | 240,012 | 2018/12/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,043    | 3,030     | 339,529 | 2020/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,492    | 2,494     | 279,465 | 2022/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 2,146    | 2,132     | 238,982 | 2019/01/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 3,126    | 3,075     | 344,576 | 2021/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 5,366    | 5,080     | 569,315 | 2026/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,065    | 2,041     | 228,733 | 2019/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,561    | 2,515     | 281,823 | 2023/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 3,428    | 3,213     | 360,039 | 2046/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,100    | 2,080     | 233,161 | 2019/03/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 3,309    | 3,226     | 361,559 | 2021/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,262    | 2,192     | 245,615 | 2023/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 3,002    | 2,936     | 329,041 | 2021/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,123    | 2,055     | 230,279 | 2023/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 1,905    | 1,883     | 210,994 | 2019/04/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 6,029    | 5,695     | 638,232 | 2026/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,450    | 2,404     | 269,394 | 2021/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,070    | 2,015     | 225,817 | 2023/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.5000 | 3,423    | 3,206     | 359,333 | 2046/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,507    | 2,476     | 277,496 | 2019/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,700    | 2,647     | 296,647 | 2021/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,500    | 2,431     | 272,485 | 2023/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,100    | 2,072     | 232,262 | 2019/06/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 2,500    | 2,428     | 272,071 | 2021/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 3,000    | 2,876     | 322,307 | 2023/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,500    | 2,460     | 275,690 | 2019/07/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 5,600    | 5,223     | 585,319 | 2026/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 3,480    | 3,087     | 346,004 | 2046/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,500    | 2,458     | 275,472 | 2019/08/15 |



| 当 期 |                                  |      |        | 未 評 価 額  |           |         | 償還年月日      |
|-----|----------------------------------|------|--------|----------|-----------|---------|------------|
| 区 分 | 銘 柄                              | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額  | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額  |            |
|     |                                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円      |            |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 3,700    | 3,585     | 401,757 | 2021/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 3,700    | 3,589     | 402,209 | 2021/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 2,780    | 2,644     | 296,288 | 2023/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,400    | 2,295     | 257,259 | 2023/08/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.8750 | 2,600    | 2,559     | 286,764 | 2019/09/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,505    | 2,395     | 268,382 | 2023/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 3,042    | 2,944     | 329,935 | 2021/09/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 2,147    | 2,117     | 237,215 | 2019/10/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 0.7500 | 2,326    | 2,307     | 258,551 | 2018/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 5,500    | 5,337     | 598,027 | 2026/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 3,000    | 2,915     | 326,720 | 2021/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 2,500    | 2,423     | 271,544 | 2023/10/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.8750 | 3,650    | 3,689     | 413,391 | 2046/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,400    | 1,379     | 154,582 | 2019/11/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.0000 | 1,000    | 993       | 111,336 | 2018/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,490    | 2,481     | 278,067 | 2023/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 2,400    | 2,376     | 266,230 | 2021/11/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,440    | 1,428     | 160,072 | 2019/12/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,000    | 1,998     | 223,907 | 2021/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 1,400    | 1,393     | 156,164 | 2018/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,500    | 2,506     | 280,867 | 2023/12/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,500    | 1,487     | 166,663 | 2020/01/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 1,700    | 1,689     | 189,256 | 2019/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 4,040    | 3,996     | 447,833 | 2027/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 3,010    | 2,991     | 335,162 | 2022/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 2,480    | 2,484     | 278,381 | 2024/01/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 3,875    | 4,014     | 449,794 | 2047/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 2,130    | 2,110     | 236,501 | 2020/02/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.1250 | 2,300    | 2,283     | 255,872 | 2019/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 3,010    | 2,989     | 335,004 | 2022/02/28 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 2,300    | 2,287     | 256,284 | 2024/02/29 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.6250 | 1,900    | 1,892     | 212,054 | 2020/03/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 1,850    | 1,838     | 206,003 | 2019/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.1250 | 4,250    | 4,224     | 473,307 | 2024/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 900      | 893       | 100,095 | 2022/03/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 850      | 843       | 94,557  | 2020/04/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.3750 | 5,700    | 5,695     | 638,231 | 2027/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 3.0000 | 2,700    | 2,796     | 313,380 | 2047/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 3,000    | 2,977     | 333,575 | 2022/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 3,000    | 2,958     | 331,447 | 2024/04/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 4,000    | 3,970     | 444,851 | 2020/05/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,000    | 2,960     | 331,709 | 2022/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 4,000    | 3,972     | 445,134 | 2019/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,000    | 1,971     | 220,913 | 2024/05/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,700    | 2,678     | 300,135 | 2020/06/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.2500 | 4,000    | 3,969     | 444,784 | 2019/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.7500 | 3,000    | 2,958     | 331,447 | 2022/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.0000 | 2,400    | 2,363     | 264,864 | 2024/06/30 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 2,000    | 1,982     | 222,172 | 2020/07/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.3750 | 1,000    | 994       | 111,388 | 2019/07/31 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.2500 | 5,900    | 5,829     | 653,188 | 2027/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.5000 | 1,300    | 1,288     | 144,384 | 2020/08/15 |
|     | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 1.8750 | 2,900    | 2,873     | 322,023 | 2022/07/31 |

外国債券インデックスマザーファンド

|         |                                      | 当 期   |         |                       | 未                     |              |            |
|---------|--------------------------------------|-------|---------|-----------------------|-----------------------|--------------|------------|
| 区 分     | 銘 柄                                  | 種 類   | 年利率     | 額 面 金 額               | 評 価 額                 |              | 償還年月日      |
|         |                                      |       |         |                       | 外 貨 建 金 額             | 邦貨換算金額       |            |
|         |                                      |       | %       | 千アメリカ・ドル              | 千アメリカ・ドル              | 千円           |            |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 2. 1250 | 3, 000                | 2, 977                | 333, 575     | 2024/07/31 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 2. 7500 | 2, 800                | 2, 760                | 309, 300     | 2047/08/15 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1. 6250 | 2, 100                | 2, 057                | 230, 523     | 2022/08/31 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1. 2500 | 600                   | 594                   | 66, 654      | 2019/08/31 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1. 8750 | 2, 000                | 1, 953                | 218, 880     | 2024/08/31 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1. 3750 | 1, 000                | 987                   | 110, 661     | 2020/09/15 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1. 8750 | 2, 500                | 2, 475                | 277, 410     | 2022/09/30 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1. 3750 | 1, 000                | 993                   | 111, 292     | 2019/09/30 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 2. 1250 | 3, 400                | 3, 371                | 377, 724     | 2024/09/30 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 1. 6250 | 1, 000                | 993                   | 111, 318     | 2020/10/15 |
|         | United States Treasury Note/Bond     | 国債証券  | 2. 0000 | 2, 500                | 2, 490                | 279, 029     | 2022/10/31 |
| 通貨小計    | 銘柄数<br>金 額                           | 244銘柄 |         | 626, 026              | 632, 164              | 70, 834, 003 |            |
| カナダ     | Canada Government International Bond | 国債証券  | 2. 7500 | 千カナダ・ドル<br>325        | 千カナダ・ドル<br>377        | 32, 851      | 2064/12/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 8. 0000 | 386                   | 590                   | 51, 468      | 2027/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 5. 7500 | 983                   | 1, 363                | 118, 775     | 2029/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 5. 7500 | 1, 127                | 1, 671                | 145, 614     | 2033/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 5. 0000 | 1, 112                | 1, 608                | 140, 066     | 2037/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 3. 7500 | 1, 524                | 1, 577                | 137, 398     | 2019/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 4. 0000 | 1, 363                | 1, 799                | 156, 773     | 2041/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 3. 5000 | 1, 876                | 1, 969                | 171, 541     | 2020/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 3. 2500 | 956                   | 1, 011                | 88, 105      | 2021/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 2. 7500 | 1, 751                | 1, 838                | 160, 152     | 2022/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 3. 5000 | 1, 561                | 1, 965                | 171, 169     | 2045/12/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1. 5000 | 1, 253                | 1, 241                | 108, 156     | 2023/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 2. 5000 | 1, 405                | 1, 471                | 128, 173     | 2024/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1. 7500 | 853                   | 857                   | 74, 693      | 2019/03/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1. 7500 | 1, 627                | 1, 636                | 142, 546     | 2019/09/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 2. 7500 | 1, 197                | 1, 335                | 116, 279     | 2048/12/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 2. 2500 | 1, 156                | 1, 194                | 104, 020     | 2025/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1. 5000 | 1, 719                | 1, 720                | 149, 874     | 2020/03/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0. 7500 | 1, 831                | 1, 795                | 156, 371     | 2020/09/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1. 5000 | 1, 129                | 1, 099                | 95, 807      | 2026/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0. 7500 | 1, 237                | 1, 206                | 105, 111     | 2021/03/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0. 7500 | 1, 480                | 1, 437                | 125, 176     | 2021/09/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1. 0000 | 1, 240                | 1, 145                | 99, 768      | 2027/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0. 5000 | 1, 470                | 1, 459                | 127, 129     | 2018/11/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0. 5000 | 840                   | 802                   | 69, 899      | 2022/03/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0. 5000 | 1, 620                | 1, 604                | 139, 769     | 2019/02/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0. 7500 | 900                   | 892                   | 77, 715      | 2019/05/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1. 0000 | 700                   | 680                   | 59, 235      | 2022/09/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 0. 7500 | 1, 360                | 1, 345                | 117, 171     | 2019/08/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1. 2500 | 500                   | 498                   | 43, 401      | 2019/11/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 2. 0000 | 300                   | 301                   | 26, 285      | 2028/06/01 |
|         | CANADIAN GOVERNMENT BOND             | 国債証券  | 1. 7500 | 600                   | 602                   | 52, 473      | 2023/03/01 |
| 通貨小計    | 銘柄数<br>金 額                           | 32銘柄  |         | 37, 381               | 40, 103               | 3, 492, 978  |            |
| オーストラリア | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券  | 5. 2500 | 千オーストラリア・ドル<br>2, 455 | 千オーストラリア・ドル<br>2, 566 | 217, 823     | 2019/03/15 |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券  | 5. 7500 | 2, 420                | 2, 728                | 231, 592     | 2021/05/15 |

|        |                            | 当 期  |        |             | 未           |           |            |
|--------|----------------------------|------|--------|-------------|-------------|-----------|------------|
| 区 分    | 銘 柄                        | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額     | 評 価 額       |           | 償還年月日      |
|        |                            |      |        |             | 外 貨 建 金 額   | 邦貨換算金額    |            |
|        |                            |      | %      | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円        |            |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 2,409       | 2,560       | 217,289   | 2020/04/15 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.7500 | 2,162       | 2,513       | 213,293   | 2022/07/15 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 2,068       | 2,420       | 205,411   | 2023/04/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 2,589       | 3,091       | 262,366   | 2027/04/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 2,473       | 2,547       | 216,236   | 2024/04/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,314       | 1,403       | 119,109   | 2029/04/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 2,398       | 2,548       | 216,254   | 2025/04/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 1,358       | 1,655       | 140,512   | 2033/04/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 2,848       | 3,249       | 275,769   | 2026/04/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 2,011       | 2,049       | 173,919   | 2019/10/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 863         | 964         | 81,821    | 2037/04/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 557         | 546         | 46,366    | 2035/06/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 2,195       | 2,187       | 185,645   | 2020/11/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 712         | 734         | 62,330    | 2039/06/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 2,142       | 2,195       | 186,305   | 2027/11/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,978       | 1,931       | 163,937   | 2028/05/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 932         | 891         | 75,647    | 2047/03/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 700         | 700         | 59,413    | 2021/12/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 1,450       | 1,480       | 125,634   | 2028/11/21 |
|        | AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 100         | 100         | 8,543     | 2022/11/21 |
| 通貨小計   | 銘柄数                        | 22銘柄 |        |             |             |           |            |
|        | 金 額                        |      |        | 38,134      | 41,065      | 3,485,224 |            |
| シンガポール |                            |      |        | 千シンガポール・ドル  | 千シンガポール・ドル  |           |            |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.2500 | 696         | 727         | 60,552    | 2020/09/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.5000 | 772         | 862         | 71,716    | 2027/03/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.1250 | 438         | 465         | 38,732    | 2022/09/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.5000 | 599         | 608         | 50,613    | 2019/06/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.0000 | 503         | 536         | 44,627    | 2024/09/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.8750 | 359         | 380         | 31,657    | 2030/09/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.2500 | 495         | 505         | 42,031    | 2021/06/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.7500 | 400         | 413         | 34,357    | 2042/04/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.7500 | 491         | 514         | 42,815    | 2023/07/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 3.3750 | 368         | 413         | 34,391    | 2033/09/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.8750 | 125         | 133         | 11,064    | 2029/07/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 1.6250 | 415         | 416         | 34,617    | 2019/10/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.3750 | 124         | 127         | 10,573    | 2025/06/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.0000 | 224         | 226         | 18,865    | 2020/07/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.7500 | 318         | 331         | 27,569    | 2046/03/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.1250 | 250         | 251         | 20,932    | 2026/06/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 1.2500 | 190         | 187         | 15,572    | 2021/10/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 1.7500 | 200         | 200         | 16,670    | 2022/04/01 |
|        | SINGAPORE GOVERNMENT       | 国債証券 | 2.2500 | 150         | 145         | 12,142    | 2036/08/01 |
| 通貨小計   | 銘柄数                        | 19銘柄 |        |             |             |           |            |
|        | 金 額                        |      |        | 7,117       | 7,446       | 619,502   |            |
| イギリス   |                            |      |        | 千イギリス・ポンド   | 千イギリス・ポンド   |           |            |
|        | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 2.0000 | 2,280       | 2,365       | 355,567   | 2020/07/22 |
|        | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 2.0000 | 2,121       | 2,254       | 338,940   | 2025/09/07 |
|        | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 1.5000 | 2,477       | 2,543       | 382,305   | 2021/01/22 |
|        | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 2.5000 | 1,332       | 1,676       | 251,981   | 2065/07/22 |
|        | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 1.5000 | 1,465       | 1,495       | 224,759   | 2026/07/22 |
|        | United Kingdom Gilt        | 国債証券 | 0.5000 | 310         | 305         | 45,907    | 2022/07/22 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 当 期 末 |                        |      |        |                       |                       |            |            |
|-------|------------------------|------|--------|-----------------------|-----------------------|------------|------------|
| 区 分   | 銘 柄                    | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額               | 評 価 額                 |            | 償還年月日      |
|       |                        |      |        |                       | 外 貨 建 金 額             | 邦貨換算金額     |            |
|       |                        |      | %      | 千イギリス・ポンド             | 千イギリス・ポンド             | 千円         |            |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 1.5000 | 460                   | 419                   | 63,031     | 2047/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 1.7500 | 200                   | 195                   | 29,431     | 2037/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 1.7500 | 600                   | 599                   | 90,107     | 2057/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 1.2500 | 510                   | 503                   | 75,728     | 2027/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 0.7500 | 500                   | 493                   | 74,211     | 2023/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 8.0000 | 1,102                 | 1,383                 | 208,037    | 2021/06/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 6.0000 | 949                   | 1,394                 | 209,657    | 2028/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 1,340                 | 1,786                 | 268,542    | 2032/06/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 5.0000 | 1,472                 | 1,873                 | 281,676    | 2025/03/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 2,032                 | 2,803                 | 421,457    | 2036/03/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.7500 | 1,457                 | 2,188                 | 328,940    | 2038/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.7500 | 1,724                 | 1,889                 | 283,994    | 2020/03/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 1,708                 | 2,878                 | 432,698    | 2055/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 2,086                 | 3,169                 | 476,434    | 2046/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 1,232                 | 1,565                 | 235,397    | 2027/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.5000 | 1,596                 | 2,418                 | 363,584    | 2042/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.7500 | 1,480                 | 2,033                 | 305,654    | 2030/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 1,523                 | 2,400                 | 360,875    | 2049/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.5000 | 873                   | 917                   | 137,890    | 2019/03/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 1,246                 | 1,770                 | 266,225    | 2039/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.0000 | 1,382                 | 1,572                 | 236,384    | 2022/03/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.5000 | 1,870                 | 2,612                 | 392,776    | 2034/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.7500 | 1,428                 | 1,510                 | 227,012    | 2019/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.0000 | 1,244                 | 2,086                 | 313,672    | 2060/01/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.7500 | 1,795                 | 1,952                 | 293,512    | 2020/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 4.2500 | 1,577                 | 2,268                 | 341,073    | 2040/12/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.7500 | 1,633                 | 1,820                 | 273,624    | 2021/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.7500 | 1,352                 | 2,023                 | 304,157    | 2052/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 1.7500 | 2,242                 | 2,338                 | 351,613    | 2022/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.2500 | 2,066                 | 2,626                 | 394,780    | 2044/01/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 2.2500 | 1,942                 | 2,083                 | 313,185    | 2023/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.5000 | 1,621                 | 2,610                 | 392,381    | 2068/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 1.7500 | 2,251                 | 2,296                 | 345,204    | 2019/07/22 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 2.7500 | 1,842                 | 2,045                 | 307,500    | 2024/09/07 |
|       | United Kingdom Gilt    | 国債証券 | 3.5000 | 2,124                 | 2,828                 | 425,149    | 2045/01/22 |
| 通貨小計  | 銘柄数                    | 41銘柄 |        |                       |                       |            |            |
|       | 金 額                    |      |        | 60,444                | 75,999                | 11,425,072 |            |
| スイス   | SWISS GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.0000 | 千スイス・フラン<br>404       | 千スイス・フラン<br>499       | 56,847     | 2023/02/11 |
|       | SWISS GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.0000 | 497                   | 707                   | 80,495     | 2028/04/08 |
|       | SWISS GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.0000 | 517                   | 546                   | 62,192     | 2019/05/12 |
|       | SWISS GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.2500 | 407                   | 439                   | 49,990     | 2020/07/06 |
|       | SWISS GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.0000 | 362                   | 395                   | 44,985     | 2021/04/28 |
| 通貨小計  | 銘柄数                    | 5銘柄  |        |                       |                       |            |            |
|       | 金 額                    |      |        | 2,187                 | 2,587                 | 294,510    |            |
| デンマーク | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 千デンマーク・クローネ<br>11,512 | 千デンマーク・クローネ<br>19,533 | 348,480    | 2039/11/15 |
|       | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 8,601                 | 9,387                 | 167,471    | 2019/11/15 |
|       | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 8,050                 | 9,132                 | 162,929    | 2021/11/15 |
|       | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 4,846                 | 5,302                 | 94,599     | 2023/11/15 |
|       | DANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 8,363                 | 9,421                 | 168,079    | 2025/11/15 |

| 区 分    |     | 当 期                       |      |         | 末                     |                        |           |
|--------|-----|---------------------------|------|---------|-----------------------|------------------------|-----------|
|        |     | 銘 柄                       | 種 類  | 年利率     | 額 面 金 額               | 評 価 額                  |           |
|        |     |                           |      |         |                       | 外 貨 建 金 額              | 邦貨換算金額    |
|        |     |                           |      |         |                       |                        | 千円        |
|        |     | DANISH GOVERNMENT BOND    | 国債証券 | 0.2500% | 千デンマーク・クローネ<br>3,164  | 千デンマーク・クローネ<br>3,192   | 56,956    |
|        |     | DANISH GOVERNMENT BOND    | 国債証券 | 0.5000  | 2,600                 | 2,613                  | 46,620    |
|        |     | DANISH GOVERNMENT BOND    | 国債証券 | 0.2500  | 1,500                 | 1,534                  | 27,371    |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 8銘柄                       |      |         |                       |                        |           |
|        | 金 額 |                           |      |         | 48,636                | 60,118                 | 1,072,508 |
| ノルウェー  |     | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000  | 千ノルウェー・クローネ<br>7,075  | 千ノルウェー・クローネ<br>7,491   | 101,727   |
|        |     | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500  | 6,998                 | 7,691                  | 104,457   |
|        |     | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000  | 5,224                 | 5,471                  | 74,296    |
|        |     | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000  | 4,095                 | 4,539                  | 61,651    |
|        |     | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500  | 3,395                 | 3,495                  | 47,475    |
|        |     | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000  | 3,340                 | 3,365                  | 45,709    |
|        |     | NORWEGIAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500  | 2,450                 | 2,501                  | 33,970    |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 7銘柄                       |      |         |                       |                        |           |
|        | 金 額 |                           |      |         | 32,577                | 34,557                 | 469,287   |
| スウェーデン |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 5.0000  | 千スウェーデン・クローネ<br>9,095 | 千スウェーデン・クローネ<br>10,614 | 142,025   |
|        |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 4.2500  | 8,385                 | 8,942                  | 119,649   |
|        |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 3.5000  | 4,155                 | 5,723                  | 76,575    |
|        |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 3.5000  | 8,465                 | 9,892                  | 132,365   |
|        |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 1.5000  | 7,025                 | 7,624                  | 102,009   |
|        |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 2.5000  | 5,095                 | 5,930                  | 79,353    |
|        |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 1.0000  | 5,680                 | 5,932                  | 79,371    |
|        |     | SWEDISH GOVERNMENT BOND   | 国債証券 | 0.7500  | 2,950                 | 2,955                  | 39,543    |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 8銘柄                       |      |         |                       |                        |           |
|        | 金 額 |                           |      |         | 50,850                | 57,615                 | 770,894   |
| メキシコ   |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 5.0000  | 千メキシコ・ペソ<br>21,447    | 千メキシコ・ペソ<br>20,619     | 124,333   |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 5.7500  | 13,290                | 12,099                 | 72,959    |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 8.0000  | 4,000                 | 4,204                  | 25,352    |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 8.0000  | 10,633                | 11,084                 | 66,838    |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 10.0000 | 22,119                | 25,601                 | 154,377   |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 7.5000  | 10,668                | 10,846                 | 65,406    |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 10.0000 | 6,874                 | 8,599                  | 51,857    |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 8.5000  | 8,844                 | 9,655                  | 58,221    |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 8.5000  | 22,092                | 22,379                 | 134,947   |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 8.5000  | 9,694                 | 10,683                 | 64,423    |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 8.0000  | 18,928                | 19,343                 | 116,639   |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 6.5000  | 27,826                | 27,312                 | 164,691   |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 7.7500  | 13,015                | 13,437                 | 81,028    |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 6.5000  | 13,099                | 12,791                 | 77,131    |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 7.7500  | 15,654                | 16,005                 | 96,510    |
|        |     | Mexican Bonos             | 国債証券 | 7.7500  | 6,944                 | 7,142                  | 43,068    |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 16銘柄                      |      |         |                       |                        |           |
|        | 金 額 |                           |      |         | 225,127               | 231,806                | 1,397,790 |
| マレーシア  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT      | 国債証券 | 5.7340  | 千マレーシア・リンギット<br>647   | 千マレーシア・リンギット<br>673    | 18,467    |
|        |     | MALAYSIAN GOVERNMENT      | 国債証券 | 3.5020  | 573                   | 537                    | 14,738    |
|        |     | MALAYSIAN GOVERNMENT      | 国債証券 | 5.2480  | 738                   | 787                    | 21,605    |
|        |     | MALAYSIAN GOVERNMENT      | 国債証券 | 4.3780  | 1,603                 | 1,640                  | 44,985    |
|        |     | MALAYSIAN GOVERNMENT      | 国債証券 | 4.4980  | 1,178                 | 1,174                  | 32,196    |

外国債券インデックスマザーファンド

| 当 期   |     |                          |      | 未 期      |              |              |          |            |
|-------|-----|--------------------------|------|----------|--------------|--------------|----------|------------|
| 区 分   |     | 銘 柄                      | 種 類  | 年利率      | 額 面 金 額      | 評 価 額        |          | 償還年月日      |
|       |     |                          |      |          |              | 外 貨 建 金 額    | 邦貨換算金額   |            |
|       |     |                          |      | %        | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円       |            |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 1600  | 1, 916       | 1, 958       | 53, 702  | 2021/07/15 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 3920  | 1, 514       | 1, 533       | 42, 047  | 2026/04/15 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 2320  | 650          | 632          | 17, 339  | 2031/06/30 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 4180  | 875          | 861          | 23, 610  | 2022/08/15 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 8920  | 731          | 711          | 19, 513  | 2027/03/15 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 1270  | 618          | 595          | 16, 315  | 2032/04/15 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 4920  | 1, 044       | 1, 050       | 28, 805  | 2020/03/31 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 4800  | 1, 001       | 982          | 26, 928  | 2023/03/15 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 8440  | 477          | 444          | 12, 175  | 2033/04/15 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 7330  | 586          | 558          | 15, 308  | 2028/06/15 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 8890  | 656          | 664          | 18, 224  | 2020/07/31 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 9350  | 600          | 601          | 16, 494  | 2043/09/30 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 1810  | 1, 057       | 1, 068       | 29, 300  | 2024/07/15 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 0480  | 857          | 869          | 23, 836  | 2021/09/30 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 6540  | 648          | 654          | 17, 942  | 2019/10/31 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 9550  | 737          | 729          | 20, 002  | 2025/09/15 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 6590  | 700          | 704          | 19, 328  | 2020/10/15 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 7950  | 1, 161       | 1, 160       | 31, 826  | 2022/09/30 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 2540  | 820          | 789          | 21, 638  | 2035/05/31 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 7590  | 768          | 776          | 21, 289  | 2019/03/15 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 8000  | 702          | 697          | 19, 127  | 2023/08/17 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 7360  | 930          | 910          | 24, 957  | 2046/03/15 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 9000  | 650          | 637          | 17, 491  | 2026/11/30 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 6200  | 352          | 352          | 9, 662   | 2021/11/30 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 8820  | 500          | 504          | 13, 828  | 2022/03/10 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 0590  | 750          | 755          | 20, 721  | 2024/09/30 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 8990  | 350          | 348          | 9, 549   | 2027/11/16 |
|       |     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4. 7620  | 500          | 507          | 13, 921  | 2037/04/07 |
| 通貨小計  | 銘柄数 | 33銘柄                     |      |          |              |              |          |            |
|       | 金 額 |                          |      |          | 26, 889      | 26, 874      | 736, 885 |            |
| 南アフリカ |     |                          |      |          | 千南アフリカ・ランド   | 千南アフリカ・ランド   |          |            |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 0000  | 2, 978       | 2, 993       | 24, 543  | 2018/12/21 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7. 2500  | 5, 768       | 5, 682       | 46, 600  | 2020/01/15 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 10. 5000 | 16, 434      | 17, 622      | 144, 501 | 2026/12/21 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6. 2500  | 7, 612       | 5, 229       | 42, 882  | 2036/03/31 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6. 7500  | 4, 622       | 4, 417       | 36, 225  | 2021/03/31 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6. 5000  | 8, 904       | 6, 007       | 49, 261  | 2041/02/28 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7. 0000  | 8, 999       | 7, 172       | 58, 817  | 2031/02/28 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7. 7500  | 5, 539       | 5, 340       | 43, 789  | 2023/02/28 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 7500  | 13, 452      | 11, 553      | 94, 736  | 2048/02/28 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 5000  | 11, 021      | 9, 479       | 77, 733  | 2037/01/31 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 0000  | 8, 862       | 7, 763       | 63, 664  | 2030/01/31 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 7500  | 7, 944       | 6, 818       | 55, 909  | 2044/01/31 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 2500  | 8, 243       | 7, 191       | 58, 969  | 2032/03/31 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 8750  | 4, 166       | 3, 752       | 30, 774  | 2035/02/28 |
|       |     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 9. 0000  | 2, 179       | 1, 933       | 15, 856  | 2040/01/31 |
| 通貨小計  | 銘柄数 | 15銘柄                     |      |          |              |              |          |            |
|       | 金 額 |                          |      |          | 116, 723     | 102, 959     | 844, 266 |            |
| ポーランド |     |                          |      |          | 千ポーランド・ズロチ   | 千ポーランド・ズロチ   |          |            |
|       |     | Poland Government Bond   | 国債証券 | 5. 7500  | 2, 309       | 2, 638       | 83, 369  | 2022/09/23 |
|       |     | Poland Government Bond   | 国債証券 | 5. 5000  | 1, 912       | 2, 053       | 64, 884  | 2019/10/25 |
|       |     | Poland Government Bond   | 国債証券 | 1. 5000  | 2, 478       | 2, 462       | 77, 803  | 2020/04/25 |
|       |     | Poland Government Bond   | 国債証券 | 2. 5000  | 3, 377       | 3, 192       | 100, 870 | 2026/07/25 |



|              |                             | 当 期  |        |             | 未 期         |           |            |
|--------------|-----------------------------|------|--------|-------------|-------------|-----------|------------|
| 区 分          | 銘 柄                         | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額     | 評 価 額       |           | 償還年月日      |
|              |                             |      |        |             | 外 貨 建 金 額   | 邦貨換算金額    |            |
|              |                             |      | %      | 千ポーランド・ズロチ  | 千ポーランド・ズロチ  | 千円        |            |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.0000 | 2,127       | 2,115       | 66,843    | 2021/04/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 1.7500 | 3,051       | 2,999       | 94,782    | 2021/07/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.5000 | 1,820       | 1,696       | 53,624    | 2027/07/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.2500 | 2,320       | 2,296       | 72,556    | 2022/04/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | —      | 400         | 392         | 12,392    | 2019/04/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 2.5000 | 1,300       | 1,290       | 40,786    | 2023/01/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.7500 | 827         | 1,033       | 32,674    | 2029/04/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.2500 | 2,256       | 2,466       | 77,948    | 2020/10/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 5.7500 | 1,084       | 1,224       | 38,683    | 2021/10/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 4.0000 | 2,225       | 2,367       | 74,813    | 2023/10/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 3.2500 | 1,840       | 1,893       | 59,841    | 2019/07/25 |
|              | Poland Government Bond      | 国債証券 | 3.2500 | 2,591       | 2,608       | 82,428    | 2025/07/25 |
| 通貨小計         | 銘柄数<br>金 額                  | 16銘柄 |        | 31,917      | 32,731      | 1,034,302 |            |
| ユーロ (アイルランド) | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 4.4000 | 千ユーロ<br>684 | 千ユーロ<br>737 | 97,905    | 2019/06/18 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 5.9000 | 570         | 640         | 85,009    | 2019/10/18 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 5.4000 | 1,131       | 1,535       | 203,928   | 2025/03/13 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 5.0000 | 765         | 888         | 117,952   | 2020/10/18 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 3.9000 | 504         | 607         | 80,719    | 2023/03/20 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 3.4000 | 607         | 728         | 96,725    | 2024/03/18 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 2.4000 | 761         | 879         | 116,747   | 2030/05/15 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 0.8000 | 516         | 538         | 71,507    | 2022/03/15 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 2.0000 | 681         | 717         | 95,225    | 2045/02/18 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 1.0000 | 1,073       | 1,107       | 147,127   | 2026/05/15 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 1.7000 | 350         | 360         | 47,942    | 2037/05/15 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | —      | 50          | 50          | 6,659     | 2022/10/18 |
|              | IRISH TREASURY              | 国債証券 | 4.5000 | 1,035       | 1,160       | 154,097   | 2020/04/18 |
| 国 小 計        | 銘柄数<br>金 額                  | 13銘柄 |        | 8,727       | 9,950       | 1,321,550 |            |
| ユーロ (オランダ)   | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 7.5000 | 千ユーロ<br>548 | 千ユーロ<br>765 | 101,731   | 2023/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 1,239       | 1,856       | 246,554   | 2028/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 1,355       | 2,083       | 276,648   | 2037/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 791         | 953         | 126,587   | 2023/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 1,347       | 1,450       | 192,668   | 2019/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 1,146       | 1,270       | 168,762   | 2020/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 1,349       | 2,112       | 280,576   | 2042/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,463       | 1,662       | 220,792   | 2021/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,438       | 1,609       | 213,694   | 2022/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 1,168       | 1,445       | 192,013   | 2033/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 1,385       | 1,531       | 203,406   | 2023/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 924         | 944         | 125,475   | 2019/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 1,084       | 1,490       | 197,915   | 2047/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 1,514       | 1,713       | 227,539   | 2024/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,374       | 1,400       | 185,949   | 2020/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,291       | 1,297       | 172,278   | 2025/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 1,338       | 1,357       | 180,258   | 2026/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 1,200       | 1,218       | 161,762   | 2022/01/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 900         | 921         | 122,425   | 2027/07/15 |
|              | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 200         | 200         | 26,580    | 2024/01/15 |
| 国 小 計        | 銘柄数<br>金 額                  | 20銘柄 |        | 23,054      | 27,284      | 3,623,622 |            |



外国債券インデックスマザーファンド

| 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    |            |
| ユーロ（ベルギー） | Belgium Government Bond | 国債証券 | 0.8000% | 1,399千ユーロ | 1,453千ユーロ | 193,015千円 | 2025/06/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 1.0000  | 924       | 927       | 123,177   | 2031/06/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 1.9000  | 558       | 614       | 81,666    | 2038/06/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 1.0000  | 1,283     | 1,344     | 178,512   | 2026/06/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 1.6000  | 744       | 738       | 98,049    | 2047/06/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 2.1500  | 190       | 204       | 27,220    | 2066/06/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 0.2000  | 150       | 151       | 20,177    | 2023/10/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 0.8000  | 1,000     | 1,018     | 135,278   | 2027/06/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 0.5000  | 650       | 664       | 88,289    | 2024/10/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 2.2500  | 260       | 291       | 38,734    | 2057/06/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 1.4500  | 300       | 307       | 40,815    | 2037/06/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 5.5000  | 1,706     | 2,550     | 338,712   | 2028/03/28 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 5.0000  | 1,704     | 2,751     | 365,485   | 2035/03/28 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.0000  | 1,377     | 1,637     | 217,481   | 2022/03/28 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.0000  | 821       | 871       | 115,748   | 2019/03/28 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 3.7500  | 1,736     | 1,948     | 258,741   | 2020/09/28 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.2500  | 1,674     | 2,636     | 350,109   | 2041/03/28 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.2500  | 1,446     | 1,706     | 226,674   | 2021/09/28 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.5000  | 1,001     | 1,346     | 178,762   | 2026/03/28 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.2500  | 1,316     | 1,603     | 212,940   | 2022/09/28 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 4.0000  | 680       | 958       | 127,351   | 2032/03/28 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 3.0000  | 1,123     | 1,197     | 159,002   | 2019/09/28 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 2.2500  | 1,338     | 1,514     | 201,152   | 2023/06/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 3.7500  | 753       | 1,130     | 150,080   | 2045/06/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 2.6000  | 1,505     | 1,752     | 232,723   | 2024/06/22 |
|           | Belgium Government Bond | 国債証券 | 3.0000  | 597       | 766       | 101,760   | 2034/06/22 |
| 国 小 計     | 銘柄数<br>金 額              | 26銘柄 |         | 26,235    | 32,088    | 4,261,666 |            |
| ユーロ（フランス） | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 8.5000  | 653千ユーロ   | 767千ユーロ   | 101,965   | 2019/10/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 8.5000  | 985       | 1,446     | 192,112   | 2023/04/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 6.0000  | 2,225     | 3,239     | 430,266   | 2025/10/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 5.5000  | 2,623     | 3,994     | 530,494   | 2029/04/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 5.7500  | 2,807     | 4,658     | 618,732   | 2032/10/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.7500  | 2,709     | 4,254     | 565,056   | 2035/04/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.2500  | 3,075     | 3,288     | 436,802   | 2019/04/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.0000  | 1,364     | 2,205     | 292,933   | 2055/04/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.7500  | 3,230     | 3,694     | 490,624   | 2021/04/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.0000  | 2,824     | 4,216     | 560,014   | 2038/10/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.2500  | 3,697     | 4,641     | 616,497   | 2023/10/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.5000  | 2,734     | 4,426     | 587,932   | 2041/04/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.7500  | 3,263     | 3,539     | 470,060   | 2019/10/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.5000  | 3,380     | 3,712     | 493,087   | 2020/04/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 4.0000  | 1,167     | 1,936     | 257,221   | 2060/04/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.5000  | 3,146     | 3,977     | 528,245   | 2026/04/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.5000  | 3,113     | 3,386     | 449,786   | 2020/10/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.2500  | 3,550     | 4,054     | 538,491   | 2021/10/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.0000  | 3,630     | 4,157     | 552,178   | 2022/04/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.7500  | 3,499     | 4,227     | 561,443   | 2027/10/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.2500  | 2,694     | 3,016     | 400,653   | 2022/10/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 3.2500  | 2,238     | 3,075     | 408,436   | 2045/05/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.7500  | 3,347     | 3,686     | 489,580   | 2023/05/25 |
|           | FRENCH GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.0000  | 1,920     | 1,951     | 259,228   | 2018/11/25 |

| 区 分       |     | 当 期                    |      |        | 未 期     |           |            |
|-----------|-----|------------------------|------|--------|---------|-----------|------------|
|           |     | 銘 柄                    | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額 | 評 価 額     |            |
|           |     |                        |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額     |
|           |     |                        |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円         |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 3,086   | 3,526     | 468,312    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 2,264   | 2,320     | 308,213    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 2,787   | 3,322     | 441,301    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 2,799   | 3,112     | 413,332    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 2,322   | 2,374     | 315,363    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 2,792   | 2,848     | 378,262    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 3,070   | 3,112     | 413,369    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 2,101   | 2,217     | 294,528    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 2,193   | 2,240     | 297,563    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 2,720   | 2,902     | 385,442    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 1,592   | 1,605     | 213,264    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.5000 | 2,737   | 2,763     | 367,059    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 1,079   | 1,072     | 142,384    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 587     | 572       | 76,097     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 2,170   | 2,200     | 292,209    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 2,400   | 2,354     | 312,719    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 2,000   | 2,021     | 268,422    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 620     | 661       | 87,882     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 700     | 709       | 94,167     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 2,500   | 2,602     | 345,661    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 1,000   | 1,077     | 143,045    |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | —      | 500     | 502       | 66,683     |
|           |     | FRENCH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 500     | 501       | 66,652     |
| 国 小 計     | 銘柄数 | 47銘柄                   |      |        |         |           |            |
|           | 金 額 |                        |      |        | 108,392 | 128,181   | 17,023,784 |
| ユーロ (ドイツ) |     |                        |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |            |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.2500 | 974     | 1,353     | 179,776    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.5000 | 1,567   | 2,481     | 329,605    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.6250 | 1,362   | 2,067     | 274,648    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 950     | 1,371     | 182,159    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.2500 | 951     | 1,586     | 210,674    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 1,448   | 2,336     | 310,273    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 1,775   | 2,864     | 380,478    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 2,071   | 3,191     | 423,903    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 1,225   | 2,006     | 266,498    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 1,399   | 2,463     | 327,114    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 2,682   | 2,816     | 373,995    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 2,481   | 2,650     | 352,009    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 2,075   | 2,248     | 298,641    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 1,928   | 2,112     | 280,534    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,474   | 2,169     | 288,130    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,444   | 1,560     | 207,198    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 2,333   | 2,558     | 339,848    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.2500 | 1,674   | 1,903     | 252,760    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 1,415   | 1,562     | 207,502    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 2,807   | 3,089     | 410,342    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 2,222   | 2,439     | 324,003    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 1,728   | 2,272     | 301,777    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,644   | 1,788     | 237,555    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,410   | 1,540     | 204,531    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,817   | 1,987     | 264,021    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.0000 | 1,599   | 1,798     | 238,889    |
|           |     | GERMAN GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 1,561   | 1,741     | 231,298    |

外国債券インデックスマザーファンド

|           |                         | 当 期  |        |         | 末         |            |            |
|-----------|-------------------------|------|--------|---------|-----------|------------|------------|
| 区 分       | 銘 柄                     | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額 | 評 価 額     |            | 償還年月日      |
|           |                         |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額     |            |
|           |                         |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円         |            |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 2.5000 | 1,959   | 2,599     | 345,238    | 2046/08/15 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.5000 | 1,594   | 1,756     | 233,250    | 2024/05/15 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.0000 | 1,542   | 1,649     | 219,046    | 2024/08/15 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.5000 | 2,194   | 2,268     | 301,216    | 2025/02/15 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.0000 | 2,134   | 2,283     | 303,303    | 2025/08/15 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.5000 | 2,168   | 2,229     | 296,037    | 2026/02/15 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 2,850   | 2,793     | 370,964    | 2026/08/15 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.2500 | 1,600   | 1,591     | 211,399    | 2027/02/15 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.5000 | 700     | 707       | 93,949     | 2027/08/15 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.2500 | 300     | 302       | 40,159     | 2048/08/15 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 950     | 957       | 127,135    | 2018/12/14 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,000   | 1,009     | 134,111    | 2019/03/15 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 400     | 404       | 53,754     | 2019/06/14 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 100     | 101       | 13,453     | 2019/09/13 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 1.0000 | 1,438   | 1,469     | 195,161    | 2019/02/22 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.5000 | 1,113   | 1,132     | 150,370    | 2019/04/12 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.2500 | 1,151   | 1,171     | 155,652    | 2019/10/11 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,731   | 1,758     | 233,526    | 2020/04/17 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | 0.2500 | 1,448   | 1,484     | 197,128    | 2020/10/16 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,578   | 1,606     | 213,413    | 2021/04/09 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 1,400   | 1,425     | 189,284    | 2021/10/08 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 360     | 366       | 48,612     | 2022/04/08 |
|           | GERMAN GOVERNMENT BOND  | 国債証券 | —      | 400     | 405       | 53,890     | 2022/10/07 |
| 国 小 計     | 銘柄数                     | 50銘柄 |        |         |           |            |            |
|           | 金 額                     |      |        | 76,126  | 89,437    | 11,878,234 |            |
|           |                         |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |            |            |
| ユーロ（スペイン） | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.0000 | 1,952   | 2,820     | 374,609    | 2029/01/31 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.6000 | 1,745   | 1,826     | 242,580    | 2025/04/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.9500 | 1,552   | 1,570     | 208,549    | 2030/07/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.1500 | 1,792   | 1,935     | 257,008    | 2025/10/31 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.1500 | 1,250   | 1,293     | 171,778    | 2020/07/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.9500 | 1,733   | 1,835     | 243,794    | 2026/04/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.2500 | 1,672   | 1,683     | 223,643    | 2019/01/31 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 1,747   | 1,793     | 238,162    | 2021/07/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.9000 | 1,052   | 1,083     | 143,900    | 2046/10/31 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.4500 | 550     | 598       | 79,501     | 2066/07/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.3000 | 1,730   | 1,734     | 230,317    | 2026/10/31 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.4000 | 580     | 584       | 77,636     | 2022/04/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 1,800   | 1,818     | 241,532    | 2027/04/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.3500 | 550     | 564       | 74,974     | 2033/07/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.4500 | 1,300   | 1,295     | 172,038    | 2027/10/31 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.0500 | 300     | 300       | 39,943     | 2021/01/31 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.4500 | 300     | 301       | 40,007     | 2022/10/31 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.7500 | 1,979   | 2,934     | 389,741    | 2032/07/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2000 | 1,654   | 2,143     | 284,630    | 2037/01/31 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.9000 | 1,608   | 2,279     | 302,736    | 2040/07/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.8000 | 1,682   | 2,102     | 279,174    | 2024/01/31 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.6000 | 2,382   | 2,577     | 342,367    | 2019/07/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.3000 | 1,775   | 1,932     | 256,659    | 2019/10/31 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7000 | 1,373   | 1,906     | 253,243    | 2041/07/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.0000 | 2,101   | 2,314     | 307,380    | 2020/04/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.6500 | 1,789   | 2,271     | 301,636    | 2025/07/30 |
|           | SPANISH GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.8500 | 1,681   | 1,923     | 255,491    | 2020/10/31 |

|            |                                   | 当 期  |        |         | 未 期       |           |            |
|------------|-----------------------------------|------|--------|---------|-----------|-----------|------------|
| 区 分        | 銘 柄                               | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額 | 評 価 額     |           | 償還年月日      |
|            |                                   |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額    |            |
|            |                                   |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円        |            |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.5000 | 2,515   | 2,986     | 396,685   | 2021/04/30 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.9000 | 1,965   | 2,718     | 361,080   | 2026/07/30 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.8500 | 1,978   | 2,447     | 325,054   | 2022/01/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.4000 | 2,608   | 3,270     | 434,401   | 2023/01/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 4.4000 | 1,601   | 1,954     | 259,613   | 2023/10/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.1500 | 1,270   | 1,716     | 228,023   | 2028/10/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 3.7500 | 1,254   | 1,301     | 172,887   | 2018/10/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 5.1500 | 1,049   | 1,543     | 205,057   | 2044/10/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.7500 | 1,836   | 1,916     | 254,577   | 2019/04/30 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 3.8000 | 1,970   | 2,347     | 311,809   | 2024/04/30 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.7500 | 2,097   | 2,366     | 314,245   | 2024/10/31 |
|            | SPANISH GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.4000 | 1,900   | 1,967     | 261,249   | 2020/01/31 |
| 国 小 計      | 銘柄数                               | 39銘柄 |        |         |           |           |            |
|            | 金 額                               |      |        | 61,672  | 71,965    | 9,557,727 |            |
| ユーロ (イタリア) |                                   |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |           |            |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 9.0000 | 1,106   | 1,622     | 215,456   | 2023/11/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 7.2500 | 1,110   | 1,633     | 216,910   | 2026/11/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 6.5000 | 2,392   | 3,425     | 454,897   | 2027/11/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.5000 | 1,814   | 1,970     | 261,761   | 2024/12/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.0500 | 1,445   | 1,482     | 196,955   | 2019/12/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 3.2500 | 1,429   | 1,522     | 202,153   | 2046/09/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.3500 | 1,629   | 1,693     | 224,869   | 2022/04/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.5000 | 1,687   | 1,704     | 226,434   | 2025/06/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.6500 | 1,765   | 1,644     | 218,394   | 2032/03/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.7000 | 1,511   | 1,541     | 204,749   | 2020/05/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.0000 | 1,591   | 1,655     | 219,809   | 2025/12/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.4500 | 1,504   | 1,568     | 208,365   | 2022/09/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.6500 | 774     | 788       | 104,775   | 2020/11/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.7000 | 1,440   | 1,371     | 182,202   | 2047/03/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.9500 | 2,359   | 2,388     | 317,265   | 2023/03/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.6000 | 1,286   | 1,290     | 171,343   | 2026/06/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.1000 | 812     | 817       | 108,506   | 2019/04/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.4500 | 1,674   | 1,693     | 224,898   | 2021/06/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.2500 | 924     | 884       | 117,507   | 2036/09/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.2500 | 1,568   | 1,520     | 201,919   | 2026/12/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.6500 | 700     | 690       | 91,730    | 2023/10/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.3500 | 1,358   | 1,363     | 181,077   | 2021/11/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.8000 | 448     | 405       | 53,828    | 2067/03/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.0500 | 858     | 863       | 114,665   | 2019/10/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.4500 | 700     | 706       | 93,770    | 2033/09/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.2000 | 1,060   | 1,102     | 146,443   | 2027/06/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.8500 | 300     | 314       | 41,747    | 2024/05/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.2000 | 350     | 361       | 48,036    | 2022/04/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.3500 | 120     | 121       | 16,116    | 2020/06/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 3.4500 | 600     | 650       | 86,385    | 2048/03/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 2.0500 | 1,000   | 1,023     | 135,917   | 2027/08/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.9000 | 700     | 711       | 94,560    | 2022/08/01 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 1.4500 | 550     | 558       | 74,130    | 2024/11/15 |
|            | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 0.2000 | 100     | 100       | 13,357    | 2020/10/15 |
|            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.2500 | 2,454   | 3,294     | 437,522   | 2029/11/01 |
|            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 6.0000 | 2,849   | 4,119     | 547,146   | 2031/05/01 |
|            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.7500 | 1,655   | 2,375     | 315,521   | 2033/02/01 |
|            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.2500 | 2,074   | 2,187     | 290,498   | 2019/02/01 |

外国債券インデックスマザーファンド

| 区 分          |            | 当 期                               |      |        | 未 評 価 額 |           |            |
|--------------|------------|-----------------------------------|------|--------|---------|-----------|------------|
|              |            | 銘 柄                               | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額 | 外 貨 建 金 額 |            |
|              |            |                                   |      |        |         | 千ユーロ      | 千円         |
|              |            |                                   |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円         |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 1,921   | 2,118     | 281,355    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 2,498   | 3,379     | 448,833    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.0000 | 2,790   | 3,396     | 451,136    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.7500 | 2,734   | 3,088     | 410,175    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 1,734   | 2,380     | 316,198    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 2,251   | 2,745     | 364,647    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,708   | 2,873     | 381,613    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.2500 | 2,531   | 2,734     | 363,127    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 2,118   | 2,665     | 353,994    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 2,043   | 2,784     | 369,788    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.2500 | 2,560   | 2,817     | 374,179    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.0000 | 2,214   | 2,461     | 326,915    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,070   | 2,552     | 338,975    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.7500 | 2,144   | 2,399     | 318,623    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 2,281   | 2,667     | 354,278    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.0000 | 2,012   | 2,404     | 319,339    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.5000 | 1,657   | 2,044     | 271,533    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 5.5000 | 1,910   | 2,365     | 314,151    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 1,810   | 2,308     | 306,528    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 1,894   | 2,270     | 301,543    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.7500 | 1,363   | 1,821     | 241,882    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 4.5000 | 2,194   | 2,655     | 352,710    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.5000 | 2,111   | 2,194     | 291,399    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.7500 | 1,729   | 1,942     | 257,964    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 2.5000 | 1,100   | 1,144     | 152,019    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.7500 | 2,201   | 2,570     | 341,347    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 3.5000 | 1,938   | 2,230     | 296,271    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 2.1500 | 1,593   | 1,710     | 227,143    |
|              |            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | 国債証券 | 1.5000 | 1,246   | 1,284     | 170,544    |
| 国 小 計        | 銘柄数<br>金 額 | 67銘柄                              |      |        | 107,051 | 123,182   | 16,359,857 |
| ユーロ (フィンランド) |            |                                   |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |            |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 0.3750 | 432     | 443       | 58,854     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 0.7500 | 414     | 410       | 54,535     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 0.8750 | 279     | 292       | 38,812     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 0.5000 | 411     | 416       | 55,296     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | —      | 200     | 200       | 26,576     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | —      | 270     | 273       | 36,293     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 0.5000 | 300     | 298       | 39,664     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 4.3750 | 416     | 449       | 59,734     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 4.0000 | 667     | 857       | 113,846    |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 3.3750 | 632     | 691       | 91,892     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 3.5000 | 459     | 520       | 69,149     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 2.7500 | 389     | 476       | 63,246     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 1.6250 | 612     | 666       | 88,529     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 1.5000 | 446     | 484       | 64,327     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 2.6250 | 407     | 539       | 71,660     |
|              |            | Finland Government Bond           | 国債証券 | 2.0000 | 529     | 593       | 78,877     |
| 国 小 計        | 銘柄数<br>金 額 | 16銘柄                              |      |        | 6,863   | 7,614     | 1,011,296  |
| ユーロ (オーストリア) |            |                                   |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円         |
|              |            | Austria Government Bond           | 国債証券 | 0.2500 | 527     | 535       | 71,146     |
|              |            | Austria Government Bond           | 国債証券 | 1.2000 | 873     | 936       | 124,418    |

| 区 分   |     | 当 期                     |      |        | 末       |           |             |
|-------|-----|-------------------------|------|--------|---------|-----------|-------------|
|       |     | 銘 柄                     | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額 | 評 価 額     |             |
|       |     |                         |      |        |         | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額      |
|       |     |                         |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ      | 千円          |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 0.7500 | 926     | 950       | 126,301     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.5000 | 734     | 737       | 97,998      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.5000 | 150     | 131       | 17,529      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | —      | 300     | 301       | 39,980      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 0.5000 | 380     | 378       | 50,326      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 2.1000 | 170     | 180       | 23,991      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | —      | 400     | 404       | 53,748      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 6.2500 | 825     | 1,280     | 170,103     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.9000 | 1,248   | 1,394     | 185,142     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.5000 | 1,337   | 1,538     | 204,313     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.1500 | 1,073   | 1,637     | 217,465     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.3500 | 989     | 1,052     | 139,844     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 4.8500 | 875     | 1,206     | 160,179     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.6500 | 797     | 936       | 124,393     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.4000 | 872     | 1,030     | 136,907     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.8000 | 318     | 536       | 71,245      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.9500 | 738     | 767       | 101,978     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 3.1500 | 623     | 870       | 115,608     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.7500 | 959     | 1,061     | 141,037     |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 2.4000 | 621     | 748       | 99,427      |
|       |     | Austria Government Bond | 国債証券 | 1.6500 | 932     | 1,030     | 136,914     |
| 国 小 計 | 銘柄数 | 23銘柄                    |      |        |         |           |             |
|       | 金 額 |                         |      |        | 16,667  | 19,652    | 2,610,004   |
| 通貨小計  | 銘柄数 | 301銘柄                   |      |        |         |           |             |
|       | 金 額 |                         |      |        | 434,787 | 509,357   | 67,647,744  |
| 合 計   | 銘柄数 | 767銘柄                   |      |        |         |           |             |
|       | 金 額 |                         |      |        |         |           | 164,124,972 |

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

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

| 項 目          | 当 期 末          |        |
|--------------|----------------|--------|
|              | 評 価 額          | 比 率    |
| 公社債          | 164,124,972 千円 | 98.4 % |
| コール・ローン等、その他 | 2,713,114      | 1.6    |
| 投資信託財産総額     | 166,838,087    | 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＝112.05円、1カナダ・ドル＝87.10円、1オーストラリア・ドル＝84.87円、1シンガポール・ドル＝83.19円、1イギリス・ポンド＝150.33円、1スイス・フラン＝113.83円、1デンマーク・クローネ＝17.84円、1ノルウェー・クローネ＝13.58円、1スウェーデン・クローネ＝13.38円、1メキシコ・ペソ＝6.03円、1マレーシア・リンギット＝27.42円、1南アフリカ・ランド＝8.20円、1ポーランド・ズロチ＝31.60円、1ユーロ＝132.81円です。  
(注3) 当期末における外貨建純資産（165,668,822千円）の投資信託財産総額（166,838,087千円）に対する比率は、99.3%です。



■資産、負債、元本および基準価額の状況

| 2017年11月30日現在  |                  |
|----------------|------------------|
| 項 目            | 当 期 末            |
| (A)資産          | 167,865,673,143円 |
| コール・ローン等       | 1,410,795,637    |
| 公社債（評価額）       | 164,124,972,994  |
| 未収入金           | 1,033,909,250    |
| 未収利息           | 1,273,446,527    |
| 前払費用           | 22,548,735       |
| (B)負債          | 1,144,611,298    |
| 未払金            | 1,037,447,242    |
| 未払解約金          | 107,164,056      |
| (C)純資産総額（A－B）  | 166,721,061,845  |
| 元本             | 59,383,778,765   |
| 次期繰越損益金        | 107,337,283,080  |
| (D)受益権総口数      | 59,383,778,765口  |
| 1万口当り基準価額（C／D） | 28,075円          |

\*期首における元本額は59,006,131,580円、当期中における追加設定元本額は6,421,510,499円、同解約元本額は6,043,863,314円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスV A 938,947,637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）31,434,341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）236,831,181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）64,229,316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）766,547,584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）248,867,657円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）525,569,264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）400,023,699円、D－I's 外国債券インデックス880,097円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 22,820円、iFree 外国債券インデックス575,119,716円、iFree 8 資産バランス245,604,315円、D Cダイワ外国債券インデックス40,005,557,043円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 631,956,912円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 299,143,351円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 190,473,853円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）268,358,922円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）217,548,839円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）67,378,321円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 11,337,304円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 17,901,368円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 1,288,876円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A 497,823,550円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 166,073,932円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 6,394,036,947円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 359,421,809円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 142,269,988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）353,656,108円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券126,558,233円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド21,849,007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）374,472円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,466,036,292円、ダイワライフスタイル2 5 34,455,585円、ダイワライフスタイル5 0 59,697,716円、ダイワライフスタイル7 5 16,502,710円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は28,075円です。

■損益の状況

| 当期 自 2016年12月1日 至 2017年11月30日 |                  |
|-------------------------------|------------------|
| 項 目                           | 当 期              |
| (A) 配当等収益                     | 3,993,795,740円   |
| 受取利息                          | 3,995,331,764    |
| その他収益金                        | 78,462           |
| 支払利息                          | △ 1,614,486      |
| (B) 有価証券売買損益                  | 6,841,179,885    |
| 売買益                           | 9,157,968,240    |
| 売買損                           | △ 2,316,788,355  |
| (C) その他費用                     | △ 41,127,747     |
| (D) 当期損益金（A＋B＋C）              | 10,793,847,878   |
| (E) 前期繰越損益金                   | 95,970,997,679   |
| (F) 解約差損益金                    | △ 10,392,944,222 |
| (G) 追加信託差損益金                  | 10,965,381,745   |
| (H) 合計（D＋E＋F＋G）               | 107,337,283,080  |
| 次期繰越損益金（H）                    | 107,337,283,080  |

（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。



# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第7期（決算日 2017年7月5日）

（計算期間 2016年7月6日～2017年7月5日）

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの第7期にかかる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・マーケットツ グローバル・ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。                                                                                                                                                                                                                                       |
| 主要投資対象 | 新興国通貨建ての債券                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 運用方法   | ①主として、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・マーケットツ グローバル ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。<br>②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の10%以下                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

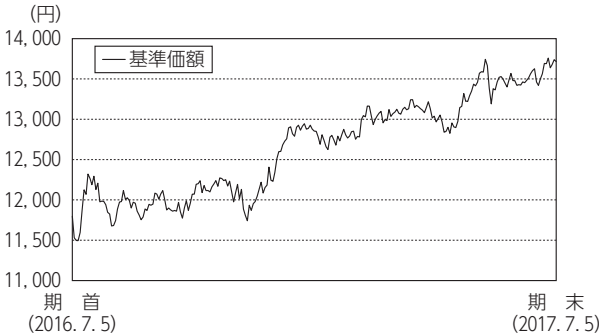
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日              | 基 準 価 額 |       | JPMorgan 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       | 騰落率 % | 円                                                                     | 騰落率 % |         |
| (期首) 2016年 7 月 5 日 | 11,798  | —     | 12,413                                                                | —     | 97.3    |
| 7 月末               | 11,941  | 1.2   | 12,582                                                                | 1.4   | 97.5    |
| 8 月末               | 11,945  | 1.2   | 12,579                                                                | 1.3   | 97.5    |
| 9 月末               | 11,870  | 0.6   | 12,563                                                                | 1.2   | 97.8    |
| 10 月末              | 12,172  | 3.2   | 12,859                                                                | 3.6   | 97.2    |
| 11 月末              | 12,184  | 3.3   | 12,815                                                                | 3.2   | 97.4    |
| 12 月末              | 12,886  | 9.2   | 13,572                                                                | 9.3   | 94.7    |
| 2017年 1 月末         | 12,805  | 8.5   | 13,524                                                                | 9.0   | 96.3    |
| 2 月末               | 12,997  | 10.2  | 13,743                                                                | 10.7  | 96.7    |
| 3 月末               | 13,217  | 12.0  | 14,083                                                                | 13.5  | 97.2    |
| 4 月末               | 13,220  | 12.1  | 13,972                                                                | 12.6  | 97.1    |
| 5 月末               | 13,400  | 13.6  | 14,174                                                                | 14.2  | 95.7    |
| 6 月末               | 13,638  | 15.6  | 14,459                                                                | 16.5  | 95.1    |
| (期末) 2017年 7 月 5 日 | 13,715  | 16.2  | 14,485                                                                | 16.7  | 97.1    |

(注 1) 騰落率は期首比。  
(注 2) J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・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として大和投資信託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) 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・騰落率】  
期首：11,798円 期末：13,715円 騰落率：△16.2%  
【基準価額の主な変動要因】  
投資している債券の利息収入および新興国通貨の対円為替レートの上昇がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について  
○新興国債券市場  
新興国債券市場は、個別国要因でまちまちの展開となりました。  
米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことを受けて、米ドル高観測により新興国市場の資金流出懸念が高まったことや、米国の利上げ観測が強まったことなどが、新興国債券の金利上昇の材料となりました。その後は、フランス大統領選挙の先行き不透明感が高まったことや、トランプ政権の政策実行能力への懐疑的な見方が広がったことなどが、金利低下の材料となりました。国別では連続利下げが行われたブラジルで金利が低下しました。

○為替相場  
新興国為替市場は、多くの通貨が対円で上昇しました。  
原油価格の上昇や米国の大統領選挙で勝利したトランプ氏の政策への期待感などから市場のリスク選好度が強まり円安が進んだことで、新興国通貨は対円で上昇しました。その後、米国の政権運営への懸念は円高要因となった一方で、米国金利の上昇抑制は高金利通貨への需要につながり、各通貨の個別要因が対円のパフォーマンスにつながる展開となりました。通貨別では、原油価格の底堅さなどからロシア・ルーブルが上昇しました。

◆前期における「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 (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)) 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  
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  
当期のベンチマークの騰落率は16.7%となりました。一方、当ファンドの騰落率は16.2%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、税金、売買に伴う費用などが主な要因です。

《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         | —円          |
| 有価証券取引税         | —           |
| その他費用<br>(保管費用) | 27<br>( 26) |
| (その他)           | ( 1)        |
| 合 計             | 27          |

(注 1) 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、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注 2) 各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

(2016年 7 月 6 日から 2017年 7 月 5 日まで)

|     |        | 買 付 額                     | 売 付 額                            |
|-----|--------|---------------------------|----------------------------------|
| 外 国 | トルコ    | 千トルコ・リラ<br>6,831          | 千トルコ・リラ<br>2,003<br>( —)         |
|     | メキシコ   | 千メキシコ・ペソ<br>43,675        | 千メキシコ・ペソ<br>11,945<br>( —)       |
|     | フィリピン  | 千フィリピン・ペソ<br>5,245        | 千フィリピン・ペソ<br>( —)                |
|     | アルゼンチン | 千アルゼンチン・ペソ<br>9,527       | 千アルゼンチン・ペソ<br>( —)               |
|     | チリ     | 千チリ・ペソ<br>623,913         | 千チリ・ペソ<br>( —)                   |
|     | コロンビア  | 千コロンビア・ペソ<br>4,009,016    | 千コロンビア・ペソ<br>261,593<br>( —)     |
|     | インドネシア | 千インドネシア・ルピア<br>24,250,003 | 千インドネシア・ルピア<br>3,067,617<br>( —) |
|     | ブラジル   | 千ブラジル・レアル<br>9,868        | 千ブラジル・レアル<br>4,923<br>( —)       |
|     | チェコ    | 千チェコ・コルナ<br>39,115        | 千チェコ・コルナ<br>( —)                 |
|     | ルーマニア  | 千ルーマニア・レイ<br>2,278        | 千ルーマニア・レイ<br>388<br>( —)         |
|     | ロシア    | 千ロシア・ルーブル<br>84,128       | 千ロシア・ルーブル<br>18,107<br>( —)      |
|     | マレーシア  | 千マレーシア・リンギット<br>6,835     | 千マレーシア・リンギット<br>5,236<br>( —)    |
|     | 南アフリカ  | 千南アフリカ・ランド<br>19,771      | 千南アフリカ・ランド<br>8,368<br>( —)      |
|     | タイ     | 千タイ・バーツ<br>55,648         | 千タイ・バーツ<br>17,468<br>( —)        |
|     | ペルー    | 千ペルー・ソル<br>1,792          | 千ペルー・ソル<br>233<br>( —)           |
|     | ポーランド  | 千ポーランド・ズロチ<br>7,356       | 千ポーランド・ズロチ<br>2,696<br>( —)      |
|     | ハンガリー  | 千ハンガリー・フォリント<br>186,756   | 千ハンガリー・フォリント<br>88,797<br>( —)   |

(注 1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注 2) ( ) 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注 3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄  
公 社 債

(2016年7月6日から2017年7月5日まで)

| 当                                                      |         | 期                                                  |        |
|--------------------------------------------------------|---------|----------------------------------------------------|--------|
| 買                                                      |         | 付                                                  |        |
| 銘                                                      | 柄       | 銘                                                  | 柄      |
| 金 額                                                    |         | 金 額                                                |        |
| 千円                                                     |         | 千円                                                 |        |
| Chile Government International Bond (チリ) 5.5% 2020/8/5 | 105,100 | Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/7/1  | 39,175 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/7/1      | 82,681  | Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/1/1  | 39,157 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/4/1      | 49,547  | Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2018/7/25      | 28,762 |
| Poland Government Bond (ポーランド) 2.25% 2022/4/25         | 46,463  | Mexican Bonos (メキシコ) 4.75% 2018/6/14               | 28,185 |
| Thailand Government Bond (タイ) 1.875% 2022/6/17         | 44,316  | Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/4/1  | 25,768 |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.5% 2037/1/31        | 43,432  | Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/1/1  | 25,047 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/1/1      | 41,026  | Poland Government Bond (ポーランド) 3.75% 2018/4/25     | 21,956 |
| Mexican Bonos (メキシコ) 10% 2024/12/5                     | 40,966  | Poland Government Bond (ポーランド) 5.25% 2017/10/25    | 21,500 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/10/1     | 37,699  | Mexican Bonos (メキシコ) 7.75% 2017/12/14              | 18,652 |
| Czech Republic Government Bond (チェコ) 5.7% 2024/5/25    | 37,461  | Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2017/10/1 | 18,493 |

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

■組入資産明細表  
(1)外国(外貨建) 公社債(通貨別)

| 作 成 期  | 当                         |                           |         |      | 末           |           |      |      |
|--------|---------------------------|---------------------------|---------|------|-------------|-----------|------|------|
|        | 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 |
| 区 分    |                           |                           |         |      |             |           |      |      |
|        | 千トルコ・リラ                   | 千トルコ・リラ                   | 千円      | %    | %           | %         | %    | %    |
| トルコ    | 14,460                    | 13,888                    | 441,499 | 7.7  | —           | 3.5       | 3.5  | 0.6  |
| メキシコ   | 千メキシコ・ペソ<br>85,590        | 千メキシコ・ペソ<br>89,842        | 558,820 | 9.7  | —           | 5.5       | 3.4  | 0.8  |
| フィリピン  | 千フィリピン・ペソ<br>10,000       | 千フィリピン・ペソ<br>10,350       | 23,184  | 0.4  | —           | —         | 0.4  | —    |
| アルゼンチン | 千アルゼンチン・ペソ<br>8,500       | 千アルゼンチン・ペソ<br>9,302       | 62,231  | 1.1  | 1.1         | 0.7       | 0.4  | —    |
| チリ     | 千チリ・ペソ<br>590,000         | 千チリ・ペソ<br>627,866         | 106,988 | 1.9  | —           | —         | 1.9  | —    |
| コロンビア  | 千コロンビア・ペソ<br>10,015,000   | 千コロンビア・ペソ<br>10,886,796   | 403,900 | 7.0  | —           | 3.9       | 2.7  | 0.3  |
| インドネシア | 千インドネシア・ルピア<br>60,849,000 | 千インドネシア・ルピア<br>65,247,366 | 554,602 | 9.6  | —           | 7.2       | 1.8  | 0.6  |
| ブラジル   | 千ブラジル・レアル<br>19,050       | 千ブラジル・レアル<br>16,963       | 579,459 | 10.0 | —           | 3.0       | 3.4  | 3.7  |
| チェコ    | 千チェコ・コルナ<br>33,900        | 千チェコ・コルナ<br>38,627        | 189,658 | 3.3  | —           | 2.1       | 1.2  | —    |
| ルーマニア  | 千ルーマニア・レイ<br>4,940        | 千ルーマニア・レイ<br>5,325        | 149,223 | 2.6  | —           | 1.0       | 1.1  | 0.6  |
| ロシア    | 千ロシア・ルーブル<br>187,240      | 千ロシア・ルーブル<br>186,413      | 356,049 | 6.2  | —           | 3.9       | 1.5  | 0.7  |
| マレーシア  | 千マレーシア・リンギット<br>14,180    | 千マレーシア・リンギット<br>14,134    | 371,877 | 6.4  | —           | 3.3       | 2.7  | 0.4  |
| 南アフリカ  | 千南アフリカ・ランド<br>60,910      | 千南アフリカ・ランド<br>55,645      | 476,327 | 8.3  | —           | 7.3       | 0.7  | 0.2  |
| タイ     | 千タイ・バーツ<br>119,960        | 千タイ・バーツ<br>128,345        | 426,105 | 7.4  | —           | 3.4       | 2.7  | 1.3  |

| 作成期   |                         | 当 期                     |               |          | 未                   |           |          |        |
|-------|-------------------------|-------------------------|---------------|----------|---------------------|-----------|----------|--------|
| 区 分   | 額 面 金 額                 | 評 価 額                   |               | 組入比率     | うちBB格<br>以下組入<br>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   |
| ペルー   | 千ペルー・ソル<br>3,430        | 千ペルー・ソル<br>3,775        | 千円<br>131,046 | %<br>2.3 | %<br>—              | %<br>2.1  | %<br>0.2 | %<br>— |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ<br>17,190    | 千ポーランド・ズロチ<br>17,382    | 526,876       | 9.1      | —                   | 3.6       | 4.5      | 1.1    |
| ハンガリー | 千ハンガリー・フォリント<br>521,400 | 千ハンガリー・フォリント<br>594,117 | 247,568       | 4.3      | —                   | 1.7       | 2.0      | 0.7    |
| 合計    | —                       | —                       | 5,605,421     | 97.1     | 1.1                 | 52.2      | 34.1     | 10.9   |

(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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。  
(注 3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。  
(注 4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

|      |                        | 当 期  |         |          | 未         |         |            |
|------|------------------------|------|---------|----------|-----------|---------|------------|
| 区 分  | 銘 柄                    | 種 類  | 年利率     | 額 面 金 額  | 評 価 額     |         | 償還年月日      |
|      |                        |      |         |          | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額  |            |
| トルコ  | Turkey Government Bond | 国債証券 | %       | 千トルコ・リラ  | 千トルコ・リラ   | 千円      |            |
|      |                        |      | 10.5000 | 680      | 680       | 21,621  | 2020/01/15 |
|      |                        |      | 9.5000  | 510      | 493       | 15,681  | 2022/01/12 |
|      |                        |      | 8.5000  | 790      | 733       | 23,305  | 2022/09/14 |
|      |                        |      | 7.1000  | 780      | 672       | 21,392  | 2023/03/08 |
|      |                        |      | 8.8000  | 790      | 734       | 23,356  | 2023/09/27 |
|      |                        |      | 8.8000  | 630      | 613       | 19,516  | 2018/11/14 |
|      |                        |      | 10.4000 | 470      | 467       | 14,847  | 2019/03/27 |
|      |                        |      | 10.4000 | 680      | 683       | 21,725  | 2024/03/20 |
|      |                        |      | 8.5000  | 1,160    | 1,114     | 35,438  | 2019/07/10 |
|      |                        |      | 9.0000  | 630      | 590       | 18,775  | 2024/07/24 |
|      |                        |      | 7.4000  | 570      | 529       | 16,842  | 2020/02/05 |
|      |                        |      | 8.0000  | 1,490    | 1,311     | 41,683  | 2025/03/12 |
|      |                        |      | 9.4000  | 1,180    | 1,148     | 36,518  | 2020/07/08 |
|      |                        |      | 10.7000 | 910      | 915       | 29,116  | 2021/02/17 |
|      |                        |      | 10.6000 | 1,170    | 1,189     | 37,808  | 2026/02/11 |
|      |                        |      | 9.2000  | 1,010    | 968       | 30,791  | 2021/09/22 |
|      |                        |      | 11.0000 | 520      | 530       | 16,853  | 2022/03/02 |
|      |                        |      | 11.0000 | 490      | 510       | 16,223  | 2027/02/24 |
| 通貨小計 | 銘柄数                    | 18銘柄 |         |          |           |         |            |
|      | 金 額                    |      |         | 14,460   | 13,888    | 441,499 |            |
| メキシコ | Mexican Bonos          | 国債証券 | %       | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ  | 千円      |            |
|      |                        |      | 5.0000  | 9,800    | 9,446     | 58,754  | 2019/12/11 |
|      |                        |      | 5.7500  | 4,900    | 4,571     | 28,435  | 2026/03/05 |
|      |                        |      | 8.0000  | 1,300    | 1,403     | 8,730   | 2047/11/07 |
|      |                        |      | 8.0000  | 4,250    | 4,534     | 28,203  | 2023/12/07 |
|      |                        |      | 10.0000 | 9,350    | 11,109    | 69,102  | 2024/12/05 |
|      |                        |      | 7.5000  | 4,030    | 4,222     | 26,265  | 2027/06/03 |
|      |                        |      | 10.0000 | 2,390    | 3,078     | 19,146  | 2036/11/20 |
|      |                        |      | 8.5000  | 2,430    | 2,743     | 17,063  | 2029/05/31 |
|      |                        |      | 8.5000  | 6,900    | 7,060     | 43,918  | 2018/12/13 |

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

|        |     | 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        |            |
|        |     | Mexican Bonos                            | 国債証券 | %<br>8.5000  | 千メキシコ・ペソ<br>3,300        | 千メキシコ・ペソ<br>3,731        | 千円<br>23,212  | 2038/11/18 |
|        |     | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 8.0000       | 6,590                    | 6,832                    | 42,498        | 2020/06/11 |
|        |     | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 6.5000       | 9,950                    | 9,904                    | 61,608        | 2021/06/10 |
|        |     | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 7.7500       | 4,950                    | 5,266                    | 32,759        | 2031/05/29 |
|        |     | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 6.5000       | 5,450                    | 5,415                    | 33,681        | 2022/06/09 |
|        |     | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 7.7500       | 7,820                    | 8,194                    | 50,972        | 2042/11/13 |
|        |     | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 7.7500       | 2,180                    | 2,325                    | 14,466        | 2034/11/23 |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 16銘柄                                     |      |              |                          |                          |               |            |
|        | 金 額 |                                          |      |              | 85,590                   | 89,842                   | 558,820       |            |
| フィリピン  |     | Philippine Government International Bond | 国債証券 | %<br>4.9500  | 千フィリピン・ペソ<br>10,000      | 千フィリピン・ペソ<br>10,350      | 千円<br>23,184  | 2021/01/15 |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 1銘柄                                      |      |              |                          |                          |               |            |
|        | 金 額 |                                          |      |              | 10,000                   | 10,350                   | 23,184        |            |
| アルゼンチン |     | REPUBLIC OF ARGENTINA                    | 国債証券 | %<br>18.2000 | 千アルゼンチン・ペソ<br>3,100      | 千アルゼンチン・ペソ<br>3,309      | 千円<br>22,138  | 2021/10/03 |
|        |     | REPUBLIC OF ARGENTINA                    | 国債証券 | 16.0000      | 1,400                    | 1,509                    | 10,095        | 2023/10/17 |
|        |     | REPUBLIC OF ARGENTINA                    | 国債証券 | 15.5000      | 4,000                    | 4,483                    | 29,997        | 2026/10/17 |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 3銘柄                                      |      |              |                          |                          |               |            |
|        | 金 額 |                                          |      |              | 8,500                    | 9,302                    | 62,231        |            |
| チリ     |     | Chile Government International Bond      | 国債証券 | %<br>5.5000  | 千チリ・ペソ<br>590,000        | 千チリ・ペソ<br>627,866        | 千円<br>106,988 | 2020/08/05 |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 1銘柄                                      |      |              |                          |                          |               |            |
|        | 金 額 |                                          |      |              | 590,000                  | 627,866                  | 106,988       |            |
| コロンビア  |     | Colombia Government International Bond   | 国債証券 | %<br>9.8500  | 千コロンビア・ペソ<br>90,000      | 千コロンビア・ペソ<br>115,672     | 千円<br>4,291   | 2027/06/28 |
|        |     | Colombia Government International Bond   | 国債証券 | 7.7500       | 95,000                   | 102,301                  | 3,795         | 2021/04/14 |
|        |     | Colombia Government International Bond   | 国債証券 | 4.3750       | 45,000                   | 42,086                   | 1,561         | 2023/03/21 |
|        |     | Colombian TES                            | 国債証券 | 5.0000       | 520,000                  | 522,147                  | 19,371        | 2018/11/21 |
|        |     | Colombian TES                            | 国債証券 | 7.0000       | 735,000                  | 761,731                  | 28,260        | 2019/09/11 |
|        |     | Colombian TES                            | 国債証券 | 11.0000      | 1,465,000                | 1,694,008                | 62,847        | 2020/07/24 |
|        |     | Colombian TES                            | 国債証券 | 7.0000       | 1,625,000                | 1,704,966                | 63,254        | 2022/05/04 |
|        |     | Colombian TES                            | 国債証券 | 10.0000      | 1,650,000                | 2,011,861                | 74,640        | 2024/07/24 |
|        |     | Colombian TES                            | 国債証券 | 6.0000       | 940,000                  | 897,596                  | 33,300        | 2028/04/28 |
|        |     | Colombian TES                            | 国債証券 | 7.5000       | 1,530,000                | 1,631,729                | 60,537        | 2026/08/26 |
|        |     | Colombian TES                            | 国債証券 | 7.7500       | 940,000                  | 1,020,811                | 37,872        | 2030/09/18 |
|        |     | Colombian TES                            | 国債証券 | 7.0000       | 380,000                  | 381,881                  | 14,167        | 2032/06/30 |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 12銘柄                                     |      |              |                          |                          |               |            |
|        | 金 額 |                                          |      |              | 10,015,000               | 10,886,796               | 403,900       |            |
| インドネシア |     | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | %<br>8.2500  | 千インドネシア・ルピア<br>4,750,000 | 千インドネシア・ルピア<br>5,047,587 | 千円<br>42,904  | 2036/05/15 |
|        |     | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 8.7500       | 4,000,000                | 4,486,200                | 38,132        | 2031/05/15 |
|        |     | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 11.0000      | 2,400,000                | 2,710,488                | 23,039        | 2020/11/15 |
|        |     | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 12.8000      | 600,000                  | 726,318                  | 6,173         | 2021/06/15 |
|        |     | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 11.0000      | 1,000,000                | 1,246,910                | 10,598        | 2025/09/15 |
|        |     | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 10.5000      | 980,000                  | 1,234,280                | 10,491        | 2030/08/15 |
|        |     | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 8.2500       | 5,710,000                | 6,016,569                | 51,140        | 2021/07/15 |

| 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       |            |  |  |  |
|                         |            | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券      | 9.5000    | 千インドネシア・ルピア<br>1,270,000 | 千インドネシア・ルピア<br>1,499,997 | 千円<br>12,749 | 2031/07/15 |  |  |  |
|                         |            | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券      | 8.3750    | 5,524,000                | 6,088,276                | 51,750       | 2026/09/15 |  |  |  |
|                         |            | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券      | 8.2500    | 3,350,000                | 3,584,701                | 30,469       | 2032/06/15 |  |  |  |
|                         |            | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券      | 7.0000    | 4,230,000                | 4,282,071                | 36,397       | 2027/05/15 |  |  |  |
|                         |            | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券      | 7.0000    | 2,560,000                | 2,591,334                | 22,026       | 2022/05/15 |  |  |  |
|                         |            | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券      | 5.6250    | 1,410,000                | 1,330,673                | 11,310       | 2023/05/15 |  |  |  |
|                         |            | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券      | 6.1250    | 1,200,000                | 1,103,292                | 9,377        | 2028/05/15 |  |  |  |
|                         |            | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券      | 6.6250    | 1,975,000                | 1,808,152                | 15,369       | 2033/05/15 |  |  |  |
|                         |            | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券      | 8.3750    | 4,720,000                | 5,065,220                | 43,054       | 2034/03/15 |  |  |  |
|                         |            | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券      | 8.3750    | 6,350,000                | 6,859,714                | 58,307       | 2024/03/15 |  |  |  |
|                         |            | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券      | 9.0000    | 4,920,000                | 5,572,096                | 47,362       | 2029/03/15 |  |  |  |
| Indonesia Treasury Bond | 国債証券       | 7.8750                                   | 3,900,000 | 3,993,483 | 33,944                   | 2019/04/15               |              |            |  |  |  |
| 通貨小計                    | 銘柄数<br>金 額 | 19銘柄                                     |           |           | 60,849,000               | 65,247,366               | 554,602      |            |  |  |  |
| 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<br>1,880       | 千ブラジル・レアル<br>1,888       | 千円<br>64,504 | 2021/01/01 |  |  |  |
|                         |            | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券      | 10.0000   | 2,330                    | 2,308                    | 78,841       | 2023/01/01 |  |  |  |
|                         |            | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券      | 10.0000   | 280                      | 284                      | 9,728        | 2019/01/01 |  |  |  |
|                         |            | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券      | 10.0000   | 1,390                    | 1,360                    | 46,458       | 2025/01/01 |  |  |  |
|                         |            | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券      | 10.0000   | 1,380                    | 1,340                    | 45,792       | 2027/01/01 |  |  |  |
|                         |            | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国債証券      | —         | 2,370                    | 2,089                    | 71,392       | 2019/01/01 |  |  |  |
|                         |            | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国債証券      | —         | 1,510                    | 1,269                    | 43,375       | 2019/07/01 |  |  |  |
|                         |            | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国債証券      | —         | 1,580                    | 1,261                    | 43,087       | 2020/01/01 |  |  |  |
|                         |            | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国債証券      | —         | 1,270                    | 1,145                    | 39,141       | 2018/10/01 |  |  |  |
|                         |            | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国債証券      | —         | 3,340                    | 2,531                    | 86,469       | 2020/07/01 |  |  |  |
|                         |            | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国債証券      | —         | 1,720                    | 1,483                    | 50,668       | 2019/04/01 |  |  |  |
| 通貨小計                    | 銘柄数<br>金 額 | 11銘柄                                     |           |           | 19,050                   | 16,963                   | 579,459      |            |  |  |  |
| チェコ                     |            | Czech Republic Government Bond           | 国債証券      | 3.7500    | 千チェコ・コルナ<br>3,500        | 千チェコ・コルナ<br>3,921        | 千円<br>19,253 | 2020/09/12 |  |  |  |
|                         |            | Czech Republic Government Bond           | 国債証券      | 3.8500    | 3,300                    | 3,832                    | 18,817       | 2021/09/29 |  |  |  |
|                         |            | Czech Republic Government Bond           | 国債証券      | 2.5000    | 3,100                    | 3,535                    | 17,357       | 2028/08/25 |  |  |  |
|                         |            | Czech Republic Government Bond           | 国債証券      | 5.7000    | 5,600                    | 7,678                    | 37,700       | 2024/05/25 |  |  |  |
|                         |            | Czech Republic Government Bond           | 国債証券      | 1.5000    | 6,000                    | 6,226                    | 30,572       | 2019/10/29 |  |  |  |
|                         |            | Czech Republic Government Bond           | 国債証券      | 4.7000    | 3,000                    | 3,718                    | 18,257       | 2022/09/12 |  |  |  |
|                         |            | Czech Republic Government Bond           | 国債証券      | 2.4000    | 3,100                    | 3,501                    | 17,192       | 2025/09/17 |  |  |  |
|                         |            | Czech Republic Government Bond           | 国債証券      | 1.0000    | 3,200                    | 3,230                    | 15,860       | 2026/06/26 |  |  |  |
|                         |            | Czech Republic Government Bond           | 国債証券      | 0.9500    | 3,100                    | 2,983                    | 14,647       | 2030/05/15 |  |  |  |
| 通貨小計                    | 銘柄数<br>金 額 | 9銘柄                                      |           |           | 33,900                   | 38,627                   | 189,658      |            |  |  |  |
| ルーマニア                   |            | Romania Government Bond                  | 国債証券      | 5.8500    | 千ルーマニア・レイ<br>430         | 千ルーマニア・レイ<br>493         | 千円<br>13,831 | 2023/04/26 |  |  |  |
|                         |            | Romania Government Bond                  | 国債証券      | 4.7500    | 360                      | 383                      | 10,747       | 2019/06/24 |  |  |  |
|                         |            | Romania Government Bond                  | 国債証券      | 5.6000    | 420                      | 447                      | 12,533       | 2018/11/28 |  |  |  |
|                         |            | Romania Government Bond                  | 国債証券      | 5.9500    | 440                      | 497                      | 13,946       | 2021/06/11 |  |  |  |
|                         |            | Romania Government Bond                  | 国債証券      | 5.7500    | 770                      | 852                      | 23,895       | 2020/04/29 |  |  |  |



ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

|       |                                      | 当 期  |         |              | 末            |          |            |
|-------|--------------------------------------|------|---------|--------------|--------------|----------|------------|
| 区 分   | 銘 柄                                  | 種 類  | 年利率     | 額 面 金 額      | 評 価 額        |          | 償還年月日      |
|       |                                      |      |         |              | 外 貨 建 金 額    | 邦貨換算金額   |            |
|       |                                      |      | %       | 千ルーマニア・レイ    | 千ルーマニア・レイ    | 千円       |            |
|       | Romania Government Bond              | 国債証券 | 4. 7500 | 580          | 624          | 17, 511  | 2025/02/24 |
|       | Romania Government Bond              | 国債証券 | 2. 5000 | 360          | 367          | 10, 311  | 2019/04/29 |
|       | Romania Government Bond              | 国債証券 | 3. 2500 | 430          | 443          | 12, 428  | 2021/03/22 |
|       | Romania Government Bond              | 国債証券 | 5. 8000 | 300          | 346          | 9, 698   | 2027/07/26 |
|       | Romania Government Bond              | 国債証券 | 2. 2500 | 370          | 374          | 10, 503  | 2020/02/26 |
|       | Romania Government Bond              | 国債証券 | 3. 5000 | 480          | 493          | 13, 815  | 2022/12/19 |
| 通貨小計  | 銘柄数                                  | 11銘柄 |         |              |              |          |            |
|       | 金 額                                  |      |         | 4, 940       | 5, 325       | 149, 223 |            |
|       |                                      |      | %       | 千ロシア・ルーブル    | 千ロシア・ルーブル    | 千円       |            |
| ロシア   | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 7. 6000 | 7, 880       | 7, 824       | 14, 945  | 2021/04/14 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 7. 5000 | 7, 130       | 7, 106       | 13, 573  | 2019/02/27 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 8. 1500 | 18, 760      | 19, 584      | 37, 405  | 2027/02/03 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 7. 6000 | 11, 910      | 11, 844      | 22, 622  | 2022/07/20 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 6. 8000 | 6, 500       | 6, 363       | 12, 154  | 2019/12/11 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 7. 0000 | 8, 400       | 8, 101       | 15, 474  | 2023/01/25 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 7. 0500 | 11, 660      | 11, 111      | 21, 222  | 2028/01/19 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 6. 4000 | 14, 100      | 13, 651      | 26, 074  | 2020/05/27 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 6. 7000 | 15, 700      | 15, 464      | 29, 537  | 2019/05/15 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 7. 0000 | 14, 300      | 13, 838      | 26, 432  | 2023/08/16 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 7. 5000 | 18, 300      | 18, 111      | 34, 593  | 2021/08/18 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 8. 5000 | 16, 300      | 17, 343      | 33, 125  | 2031/09/17 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 7. 7500 | 15, 300      | 15, 362      | 29, 342  | 2026/09/16 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 7. 4000 | 10, 000      | 9, 880       | 18, 870  | 2022/12/07 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ           | 国債証券 | 7. 7000 | 11, 000      | 10, 824      | 20, 673  | 2033/03/23 |
| 通貨小計  | 銘柄数                                  | 15銘柄 |         |              |              |          |            |
|       | 金 額                                  |      |         | 187, 240     | 186, 413     | 356, 049 |            |
|       |                                      |      | %       | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円       |            |
| マレーシア | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 4. 3900 | 600          | 610          | 16, 069  | 2023/07/07 |
|       | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 4. 0700 | 870          | 861          | 22, 654  | 2026/09/30 |
|       | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 3. 7430 | 280          | 279          | 7, 343   | 2021/08/26 |
|       | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 3. 2260 | 530          | 524          | 13, 800  | 2020/04/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 4. 3780 | 970          | 988          | 26, 002  | 2019/11/29 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 4. 1600 | 920          | 932          | 24, 530  | 2021/07/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 4. 2320 | 670          | 651          | 17, 147  | 2031/06/30 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 3. 5800 | 510          | 511          | 13, 460  | 2018/09/28 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 3. 4180 | 440          | 431          | 11, 339  | 2022/08/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 3. 4920 | 540          | 538          | 14, 171  | 2020/03/31 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 3. 4800 | 860          | 837          | 22, 036  | 2023/03/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 4. 1810 | 740          | 748          | 19, 689  | 2024/07/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 4. 0480 | 650          | 656          | 17, 279  | 2021/09/30 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 3. 6540 | 910          | 913          | 24, 033  | 2019/10/31 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 3. 9550 | 660          | 654          | 17, 210  | 2025/09/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 3. 6590 | 590          | 590          | 15, 529  | 2020/10/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 3. 7950 | 590          | 589          | 15, 520  | 2022/09/30 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 4. 2540 | 570          | 551          | 14, 504  | 2035/05/31 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT                 | 国債証券 | 3. 7590 | 380          | 382          | 10, 054  | 2019/03/15 |

|       |                          | 当 期  |          |              | 末            |          |            |
|-------|--------------------------|------|----------|--------------|--------------|----------|------------|
| 区 分   | 銘 柄                      | 種 類  | 年利率      | 額 面 金 額      | 評 価 額        |          | 償還年月日      |
|       |                          |      |          |              | 外 貨 建 金 額    | 邦貨換算金額   |            |
|       |                          |      | %        | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円       |            |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 8000  | 500          | 494          | 13, 010  | 2023/08/17 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 9000  | 800          | 790          | 20, 787  | 2026/11/30 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3. 6200  | 600          | 596          | 15, 699  | 2021/11/30 |
| 通貨小計  | 銘柄数                      | 22銘柄 |          |              |              |          |            |
|       | 金 額                      |      |          | 14, 180      | 14, 134      | 371, 877 |            |
|       |                          |      | %        | 千南アフリカ・ランド   | 千南アフリカ・ランド   | 千円       |            |
| 南アフリカ | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 0000  | 1, 120       | 1, 127       | 9, 654   | 2018/12/21 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7. 2500  | 2, 590       | 2, 567       | 21, 981  | 2020/01/15 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 10. 5000 | 8, 450       | 9, 379       | 80, 291  | 2026/12/21 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6. 2500  | 3, 220       | 2, 282       | 19, 535  | 2036/03/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6. 7500  | 2, 560       | 2, 476       | 21, 200  | 2021/03/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6. 5000  | 4, 280       | 3, 002       | 25, 698  | 2041/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7. 0000  | 4, 240       | 3, 478       | 29, 773  | 2031/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7. 7500  | 2, 980       | 2, 924       | 25, 031  | 2023/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 7500  | 7, 320       | 6, 576       | 56, 296  | 2048/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 5000  | 8, 350       | 7, 468       | 63, 929  | 2037/01/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 0000  | 5, 700       | 5, 166       | 44, 223  | 2030/01/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 7500  | 3, 200       | 2, 869       | 24, 566  | 2044/01/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 2500  | 3, 800       | 3, 438       | 29, 430  | 2032/03/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8. 8750  | 2, 100       | 1, 961       | 16, 786  | 2035/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 9. 0000  | 1, 000       | 926          | 7, 928   | 2040/01/31 |
| 通貨小計  | 銘柄数                      | 15銘柄 |          |              |              |          |            |
|       | 金 額                      |      |          | 60, 910      | 55, 645      | 476, 327 |            |
|       |                          |      | %        | 千タイ・バーツ      | 千タイ・バーツ      | 千円       |            |
| タイ    | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3. 8750  | 18, 300      | 19, 115      | 63, 465  | 2019/06/13 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 4. 8750  | 12, 950      | 15, 805      | 52, 472  | 2029/06/22 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3. 6250  | 11, 500      | 12, 451      | 41, 339  | 2023/06/16 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3. 8500  | 11, 310      | 12, 570      | 41, 733  | 2025/12/12 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3. 6500  | 19, 600      | 21, 138      | 70, 179  | 2021/12/17 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3. 4500  | 2, 800       | 2, 888       | 9, 591   | 2019/03/08 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3. 6500  | 5, 500       | 5, 968       | 19, 815  | 2031/06/20 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 2. 5500  | 12, 000      | 12, 335      | 40, 953  | 2020/06/26 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 1. 8750  | 13, 500      | 13, 472      | 44, 728  | 2022/06/17 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3. 4000  | 5, 100       | 5, 400       | 17, 928  | 2036/06/17 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 2. 1250  | 7, 400       | 7, 197       | 23, 897  | 2026/12/17 |
| 通貨小計  | 銘柄数                      | 11銘柄 |          |              |              |          |            |
|       | 金 額                      |      |          | 119, 960     | 128, 345     | 426, 105 |            |
|       |                          |      | %        | 千ペルー・ソル      | 千ペルー・ソル      | 千円       |            |
| ペルー   | Peru Government Bond     | 国債証券 | 5. 7000  | 580          | 604          | 20, 968  | 2024/08/12 |
|       | Peru Government Bond     | 国債証券 | 6. 3500  | 770          | 819          | 28, 455  | 2028/08/12 |
|       | Peru Government Bond     | 国債証券 | 8. 2000  | 535          | 641          | 22, 269  | 2026/08/12 |
|       | Peru Government Bond     | 国債証券 | 7. 8400  | 310          | 345          | 11, 978  | 2020/08/12 |
|       | Peru Government Bond     | 国債証券 | 6. 9000  | 465          | 510          | 17, 722  | 2037/08/12 |
|       | Peru Government Bond     | 国債証券 | 6. 9500  | 770          | 854          | 29, 652  | 2031/08/12 |
| 通貨小計  | 銘柄数                      | 6銘柄  |          |              |              |          |            |
|       | 金 額                      |      |          | 3, 430       | 3, 775       | 131, 046 |            |

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

|       |                         | 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       |            |
| ポーランド | Poland Government Bond  | 国債証券  | 5.7500 | 千ポーランド・ズロチ<br>1,210    | 千ポーランド・ズロチ<br>1,390    | 千円<br>42,158 | 2022/09/23 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | 5.5000 | 880                    | 949                    | 28,790       | 2019/10/25 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | 1.5000 | 1,210                  | 1,193                  | 36,168       | 2020/04/25 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | 2.5000 | 1,740                  | 1,650                  | 50,015       | 2026/07/25 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | 2.0000 | 1,560                  | 1,541                  | 46,720       | 2021/04/25 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | —      | 1,270                  | 1,243                  | 37,696       | 2018/10/25 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | 1.7500 | 1,130                  | 1,102                  | 33,407       | 2021/07/25 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | 2.5000 | 1,140                  | 1,064                  | 32,265       | 2027/07/25 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | 2.2500 | 1,650                  | 1,624                  | 49,251       | 2022/04/25 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | —      | 830                    | 802                    | 24,329       | 2019/04/25 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | 5.2500 | 620                    | 680                    | 20,624       | 2020/10/25 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | 5.7500 | 570                    | 647                    | 19,621       | 2021/10/25 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | 4.0000 | 1,030                  | 1,100                  | 33,359       | 2023/10/25 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | 3.2500 | 810                    | 833                    | 25,258       | 2019/07/25 |
|       | Poland Government Bond  | 国債証券  | 3.2500 | 1,540                  | 1,557                  | 47,208       | 2025/07/25 |
| 通貨小計  | 銘柄数                     | 15銘柄  |        |                        |                        |              |            |
|       | 金 額                     |       |        | 17,190                 | 17,382                 | 526,876      |            |
| ハンガリー | Hungary Government Bond | 国債証券  | 3.5000 | 千ハンガリー・フォリント<br>66,300 | 千ハンガリー・フォリント<br>72,000 | 千円<br>30,002 | 2020/06/24 |
|       | Hungary Government Bond | 国債証券  | 3.0000 | 55,500                 | 57,657                 | 24,026       | 2024/06/26 |
|       | Hungary Government Bond | 国債証券  | 3.0000 | 23,000                 | 22,969                 | 9,571        | 2027/10/27 |
|       | Hungary Government Bond | 国債証券  | 2.0000 | 23,000                 | 23,907                 | 9,962        | 2019/10/30 |
|       | Hungary Government Bond | 国債証券  | 2.5000 | 39,000                 | 40,959                 | 17,067       | 2021/10/27 |
|       | Hungary Government Bond | 国債証券  | 7.5000 | 44,500                 | 54,323                 | 22,636       | 2020/11/12 |
|       | Hungary Government Bond | 国債証券  | 6.0000 | 61,800                 | 75,902                 | 31,628       | 2023/11/24 |
|       | Hungary Government Bond | 国債証券  | 6.5000 | 58,800                 | 66,123                 | 27,553       | 2019/06/24 |
|       | Hungary Government Bond | 国債証券  | 7.0000 | 63,000                 | 79,318                 | 33,051       | 2022/06/24 |
|       | Hungary Government Bond | 国債証券  | 5.5000 | 24,000                 | 25,902                 | 10,793       | 2018/12/20 |
|       | Hungary Government Bond | 国債証券  | 5.5000 | 62,500                 | 75,053                 | 31,274       | 2025/06/24 |
| 通貨小計  | 銘柄数                     | 11銘柄  |        |                        |                        |              |            |
|       | 金 額                     |       |        | 521,400                | 594,117                | 247,568      |            |
| 合 計   | 銘柄数                     | 196銘柄 |        |                        |                        |              |            |
|       | 金 額                     |       |        |                        |                        | 5,605,421    |            |

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

(注 2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2017年7月5日現在

| 項 目          | 当 期 末     |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評 価 額     | 比 率   |
|              | 千円        | %     |
| 公社債          | 5,605,421 | 92.9  |
| コール・ローン等、その他 | 430,170   | 7.1   |
| 投資信託財産総額     | 6,035,591 | 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＝113.08円、1トルコ・リラ＝31.79円、1メキシコ・ペソ＝6.22円、1フィリピン・ペソ＝2.24円、1アルゼンチン・ペソ＝6.69円、100チリ・ペソ＝17.04円、100コロンビア・ペソ＝3.71円、100インドネシア・ルピア＝0.85円、1ブラジル・レアル＝34.16円、1チェコ・コルナ＝4.91円、1ルーマニア・レイ＝28.02円、1ロシア・ルーブル＝1.91円、1マレーシア・リンギット＝26.31円、1南アフリカ・ランド＝8.56円、1タイ・バーツ＝3.32円、1ペルー・ソル＝34.71円、1ポーランド・ズロチ＝30.31円、100ハンガリー・フォリント＝41.67円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(5,615,457千円)の投資信託財産総額(6,035,591千円)に対する比率は、93.0%です。

## ■損益の状況

当期 自2016年7月6日 至2017年7月5日

| 項 目                    | 当 期           |
|------------------------|---------------|
| (A) 配当等収益              | 273,591,161円  |
| 受取利息                   | 273,617,913   |
| 支払利息                   | △ 26,752      |
| (B) 有価証券売買損益           | 360,747,361   |
| 売買益                    | 488,572,926   |
| 売買損                    | △ 127,825,565 |
| (C) その他費用              | △ 8,864,433   |
| (D) 当期損益金 (A + B + C)  | 625,474,089   |
| (E) 前期繰越損益金            | 525,594,128   |
| (F) 解約差損益金             | △ 143,268,092 |
| (G) 追加信託差損益金           | 555,416,922   |
| (H) 合計 (D + E + F + G) | 1,563,217,047 |
| 次期繰越損益金 (H)            | 1,563,217,047 |

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

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

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年7月5日現在

| 項 目               | 当 期 末          |
|-------------------|----------------|
| (A) 資産            | 6,217,272,228円 |
| コール・ローン等          | 335,332,902    |
| 公社債(評価額)          | 5,605,421,137  |
| 未収入金              | 183,046,337    |
| 未収利息              | 78,292,336     |
| 前払費用              | 15,179,516     |
| (B) 負債            | 446,564,416    |
| 未払金               | 444,498,159    |
| 未払解約金             | 2,055,457      |
| その他未払費用           | 10,800         |
| (C) 純資産総額 (A - B) | 5,770,707,812  |
| 元本                | 4,207,490,765  |
| 次期繰越損益金           | 1,563,217,047  |
| (D) 受益権総口数        | 4,207,490,765口 |
| 1万口当り基準価額 (C/D)   | 13,715円        |

\* 期首における元本額は2,923,660,797円、当期中における追加設定元本額は1,904,435,637円、同解約元本額は620,605,669円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、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) 92,883,266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) 100,049,168円、D-I's 新興国債券インデックス31,709,295円、iFree 新興国債券インデックス464,867,850円、iFree 8資産バランス325,557,701円、D-Cダイワ新興国債券インデックスファンド2,999,269,705円、ダイワ・インデックスセレクト新興国債券174,677,461円、ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド18,476,319円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,715円です。

# ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス

## 運用報告書（全体版） 第１期

（決算日 2017年11月30日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|              |                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                     |
|--------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| 商品分類         | 追加型投信／国内／不動産投信（リート）／インデックス型                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                     |
| 信託期間         | 無期限                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                     |
| 運用方針         | 投資成果を東証ＲＥＩＴ指数（配当込み、以下同じ。）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。                                                                                                                                                                                                  |                                                                                     |
| 主要投資対象       | ベビーファンド                                                                                                                                                                                                                                             | ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券                                                               |
|              | ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド                                                                                                                                                                                                                                    | わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。） |
| マザーファンドの運用方法 | ①東京証券取引所が算出・公表する「東証ＲＥＩＴ指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。<br>②投資成果を「東証ＲＥＩＴ指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証ＲＥＩＴ指数」の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。<br>③運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 |                                                                                     |
| 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<br>マザーファンドの投資信託証券組入上限比率                                                                                                                                                                                                       | 無制限                                                                                 |
| 分配方針         | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。                                                                                                                     |                                                                                     |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

### 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。

さて、「ダイワファンドラップオンラインＪ－ＲＥＩＴインデックス」は、このたび、第１期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

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）

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

設定以来の運用実績

| 決 算 期               | 基 準 価 額    |           |           | 東証REIT指数(配当込み) |           | 投資信託証券<br>組 入 比 率 | 不 動 産<br>投 信 指 数<br>先 物 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|---------------------|------------|-----------|-----------|----------------|-----------|-------------------|-----------------------------|--------------|
|                     | 税 込 分 配 金  | 期 騰 落 中 率 | (ベンチマーク)  | 期 騰 落 中 率      |           |                   |                             |              |
| 1 期 末 (2017年11月30日) | 円<br>9,372 | 円<br>0    | %<br>△6.3 | 3,189.89       | %<br>△6.1 | %<br>98.0         | %<br>1.6                    | 百万円<br>564   |

(注 1) 投資信託証券および不動産投信指数先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注 2) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、設定時を10,000として指数化したものです。

\*ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

#### ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末： 9,372円

騰落率：△6.3%

#### ■基準価額の主な変動要因

東証REIT指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざした運用を行なった結果、海外を中心とした中期的な金利上昇への警戒感や海外投資家および国内リートに投資する投資信託からの資金流出などを背景に、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。



| 年          月          日 | 基      準      価      額 | 東証REIT指数(配当込み)  |                          | 投資信託証券<br>組入比率 | 不動産投信指数<br>先物比率 |
|-------------------------|------------------------|-----------------|--------------------------|----------------|-----------------|
|                         |                        | 騰      落      率 | (ベンチマーク) 騰      落      率 |                |                 |
| (設定) 2017年 1 月11日       | 円<br>10,000            | %<br>—          | (1/10)<br>3,398.19       | %<br>—         | %<br>—          |
| 1 月末                    | 10,027                 | 0.3             | 3,407.69                 | 0.3            | 98.7            |
| 2 月末                    | 9,935                  | △0.7            | 3,376.46                 | △0.6           | 98.1            |
| 3 月末                    | 9,731                  | △2.7            | 3,307.66                 | △2.7           | 98.4            |
| 4 月末                    | 9,516                  | △4.8            | 3,234.60                 | △4.8           | 98.3            |
| 5 月末                    | 9,621                  | △3.8            | 3,271.22                 | △3.7           | 98.3            |
| 6 月末                    | 9,353                  | △6.5            | 3,180.48                 | △6.4           | 98.2            |
| 7 月末                    | 9,468                  | △5.3            | 3,220.02                 | △5.2           | 98.1            |
| 8 月末                    | 9,374                  | △6.3            | 3,188.63                 | △6.2           | 98.2            |
| 9 月末                    | 9,229                  | △7.7            | 3,139.87                 | △7.6           | 98.0            |
| 10月末                    | 9,109                  | △8.9            | 3,099.44                 | △8.8           | 98.1            |
| (期末) 2017年11月30日        | 9,372                  | △6.3            | 3,189.89                 | △6.1           | 98.0            |

(注) 騰落率は設定比。

## 投資環境について

(2017.1.11~2017.11.30)

### ■国内リート市況

国内リート市況は、設定当初より、エクイティ・ファイナンスが需給面での重しとなったことや長期金利の上昇などを背景に、軟調に推移しました。その後も、海外を中心とした中期的な金利上昇への警戒感が残っていることや、海外投資家や国内リートに投資する投資信託からの資金流出などを背景に、2017年7月にかけて下落基調で推移しました。その後、日米欧の金融政策イベントを通過したことによって先行き不透明感がやや薄れたことに加えて、国内リート市場の割安感が強まったこともあり、一時的に反発しましたが、北朝鮮に関わる地政学リスクが高まったことや投資信託からの資金流出などを背景に、11月初旬にかけて軟調に推移しました。11月中旬に入ると、自己投資口取得や合併の発表などが好感されたことで上昇し、期末を迎えました。

## ポートフォリオについて

(2017.1.11~2017.11.30)

### ■当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券を組み入れることによって行ないました。

### ■ダイワJ-REITマザーファンド

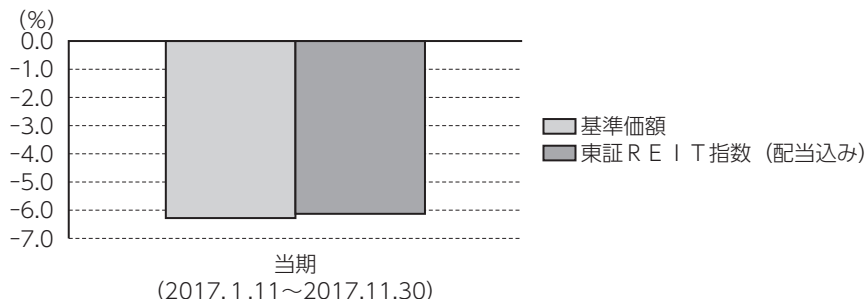
ベンチマーク（東証REIT指数（配当込み））の動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）については、期を通じて99~100%程度としました。

## ベンチマークとの差異について

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（東証REIT指数（配当込み））の騰落率は△6.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△6.3%となりました。

ポートフォリオの騰落率と東証REIT指数の騰落率の違い、先物取引の影響、信託報酬、売買等のコストが控除されたことが差異の要因となりました。



## 分配金について

当期は、分配対象額が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目           | 当 期                        |  |
|---------------|----------------------------|--|
|               | 2017年1月11日<br>～2017年11月30日 |  |
| 当期分配金（税込み）（円） | —                          |  |
| 対基準価額比率（％）    | —                          |  |
| 当期の収益（円）      | —                          |  |
| 当期の収益以外（円）    | —                          |  |
| 翌期繰越分配対象額（円）  | —                          |  |

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

引き続き「ダイワJ－R E I Tマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

### ■ダイワJ－R E I Tマザーファンド

引き続き、当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目       | 当期<br>(2017.1.11～2017.11.30) |         | 項 目 の 概 要                                                          |
|-----------|------------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------|
|           | 金 額                          | 比 率     |                                                                    |
| 信 託 報 酬   | 19円                          | 0.201%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br><b>期中の平均基準価額は9,503円です。</b>                 |
| (投 信 会 社) | (13)                         | (0.134) | 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、目<br>論見書・運用報告書の作成等の対価         |
| (販 売 会 社) | (5)                          | (0.048) | 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<br>の情報提供等の対価                |
| (受 託 銀 行) | (2)                          | (0.019) | 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   | 0                            | 0.001   | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (先 物)     | (0)                          | (0.001) |                                                                    |
| (投資信託証券)  | (0)                          | (0.000) |                                                                    |
| 有価証券取引税   | —                            | —       | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>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 | 0                            | 0.004   | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数                                          |
| (監 査 費 用) | (0)                          | (0.004) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                        |
| 合 計       | 20                           | 0.206   |                                                                    |

(注 1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 比率欄は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

|                         | 設 定     |         | 解 約   |       |
|-------------------------|---------|---------|-------|-------|
|                         | 口 数     | 金 額     | 口 数   | 金 額   |
|                         | 千口      | 千円      | 千口    | 千円    |
| ダイワJ－R E I T<br>マザーファンド | 239,310 | 570,342 | 1,316 | 3,117 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

| 種 類    | 当 期                 |       |       |
|--------|---------------------|-------|-------|
|        | ダイワJ－R E I Tマザーファンド |       |       |
|        | 買 付 額               | 売 付 額 | 期末保有額 |
|        | 百万円                 | 百万円   | 百万円   |
| 投資信託証券 | 68                  | 2,969 | 3,483 |

(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

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

| 種 類    | 当 期                 |       |
|--------|---------------------|-------|
|        | ダイワJ－R E I Tマザーファンド |       |
|        | 買 付 額               | 期末保有額 |
|        |                     | 百万円   |
| 投資信託証券 |                     | 2,303 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 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

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券オフィス投資法人です。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

| 設定時保有額 | 期中設定額 | 期中解約額 | 期末保有額 | 取 引 の 理 由        |
|--------|-------|-------|-------|------------------|
| 百万円    | 百万円   | 百万円   | 百万円   |                  |
| 1      | －     | 1     | －     | 当初設定時における取得とその処分 |

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

| 種 類                 | 当 期 末   |         |
|---------------------|---------|---------|
|                     | 口 数     | 評 価 額   |
|                     | 千口      | 千円      |
| ダイワJ－R E I Tマザーファンド | 237,994 | 563,190 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

| 項 目                 | 当 期 末   |       |
|---------------------|---------|-------|
|                     | 評 価 額   | 比 率   |
|                     | 千円      | %     |
| ダイワJ－R E I Tマザーファンド | 563,190 | 99.6  |
| コール・ローン等、その他        | 2,171   | 0.4   |
| 投資信託財産総額            | 565,361 | 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

2017年11月30日現在

| 項 目                      | 当 期 末        |
|--------------------------|--------------|
| (A) 資産                   | 565,361,043円 |
| コール・ローン等                 | 2,171,031    |
| ダイワJ－R E I Tマザーファンド(評価額) | 563,190,012  |
| (B) 負債                   | 1,049,228    |
| 未払解約金                    | 661,383      |
| 未払信託報酬                   | 378,892      |
| その他未払費用                  | 8,953        |
| (C) 純資産総額(A－B)           | 564,311,815  |
| 元本                       | 602,124,068  |
| 次期繰越損益金                  | △ 37,812,253 |
| (D) 受益権総口数               | 602,124,068口 |
| 1万口当り基準価額(C／D)           | 9,372円       |

\*設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は639,909,329円、同解約元本額は38,785,261円です。  
 \*当期末の計算口数当りの純資産額は9,372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37,812,253円です。

■損益の状況

当期 自2017年1月11日 至2017年11月30日

| 項 目              | 当 期           |
|------------------|---------------|
| (A) 配当等収益        | △ 183円        |
| 受取利息             | 6             |
| その他収益金           | 194           |
| 支払利息             | △ 383         |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 3,096,684   |
| 売買益              | 912,851       |
| 売買損              | △ 4,009,535   |
| (C) 信託報酬等        | △ 520,692     |
| (D) 当期損益金(A＋B＋C) | △ 3,617,559   |
| (E) 追加信託差損益金     | △34,194,694   |
| (配当等相当額)         | (△ 166)       |
| (売買損益相当額)        | (△34,194,528) |
| (F) 合計(D＋E)      | △37,812,253   |
| 次期繰越損益金(F)       | △37,812,253   |
| 追加信託差損益金         | △34,194,694   |
| (配当等相当額)         | (△ 166)       |
| (売買損益相当額)        | (△34,194,528) |
| 繰越損益金            | △ 3,617,559   |

(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「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■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            | 0            |
| (d) 分配準備積立金          | 0            |
| (e) 当期分配対象額(a＋b＋c＋d) | 0            |
| (f) 分配金              | 0            |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e－f)   | 0            |
| (h) 受益権総口数           | 602,124,068口 |

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の決算日（2017年9月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017年11月30日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの組入資産の内容等を254～255ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの主要な売買銘柄  
投資信託証券

（2017年1月11日から2017年11月30日まで）

| 買                |   | 付      |           |         | 売               |   | 付      |           |         |
|------------------|---|--------|-----------|---------|-----------------|---|--------|-----------|---------|
| 銘柄               | 柄 | 口数     | 金額        | 平均単価    | 銘柄              | 柄 | 口数     | 金額        | 平均単価    |
|                  |   | 千口     | 千円        | 円       |                 |   | 千口     | 千円        | 円       |
| ジャパンリアルエステイト     |   | 4.054  | 2,477,404 | 611,101 | 日本ビルファンド        |   | 6.848  | 3,923,460 | 572,935 |
| 日本リートールファンド      |   | 10.821 | 2,465,324 | 227,827 | ジャパンリアルエステイト    |   | 6.538  | 3,641,874 | 557,031 |
| オリックス不動産投資       |   | 11.655 | 2,070,827 | 177,677 | 野村不動産マスターF      |   | 20.289 | 3,056,921 | 150,668 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人  |   | 9.731  | 1,685,325 | 173,191 | 大和証券オフィス投資法人    |   | 5.242  | 2,969,633 | 566,507 |
| 日本ビルファンド         |   | 2.688  | 1,683,156 | 626,174 | 日本リートールファンド     |   | 13.303 | 2,762,105 | 207,630 |
| 野村不動産マスターF       |   | 7.964  | 1,344,723 | 168,850 | 日本プロロジスリート      |   | 10.904 | 2,603,165 | 238,734 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 |   | 16.5   | 1,289,468 | 78,149  | ユナイテッド・アーバン投資法人 |   | 15.253 | 2,489,165 | 163,191 |
| 日本プライムリアルティ      |   | 2.841  | 1,271,511 | 447,557 | 大和ハウスリート投資法人    |   | 8.772  | 2,394,527 | 272,973 |
| 森トラスト・ホテルリート投    |   | 7.756  | 1,157,906 | 149,291 | オリックス不動産投資      |   | 13.345 | 2,181,808 | 163,492 |
| 大和ハウスリート投資法人     |   | 3.904  | 1,108,506 | 283,941 | G L P 投資法人      |   | 16.227 | 1,965,351 | 121,116 |

（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、2017年11月30日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（94,976,472千口）の内容です。

(1) 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

| フ   ア   ン   ド   名  | 2017年11月30日現在 |           |     |  | フ   ア   ン   ド   名 | 2017年11月30日現在 |            |     |  |
|--------------------|---------------|-----------|-----|--|-------------------|---------------|------------|-----|--|
|                    | 口数            | 評価額       | 比率  |  |                   | 口数            | 評価額        | 比率  |  |
| <b>不動産投信</b>       | 千口            | 千円        | %   |  |                   | 千口            | 千円         | %   |  |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 9.654         | 4,382,916 | 2.0 |  | インベスコ・オフィス・リート    | 16.097        | 1,791,596  | 0.8 |  |
| MCUBS MidCity投資法人  | 5.88          | 2,328,480 | 1.0 |  | 日本ヘルスケア投資法        | 1.409         | 229,667    | 0.1 |  |
| 森ヒルズリート            | 31.208        | 4,294,220 | 1.9 |  | 積水ハウス・リート投資       | 18.223        | 2,432,770  | 1.1 |  |
| 産業ファンド             | 7.892         | 3,878,918 | 1.7 |  | トーセイ・リート投資法人      | 4.67          | 502,959    | 0.2 |  |
| アドバンス・レジデンス        | 26.897        | 7,361,708 | 3.3 |  | ケネディクス商業リート       | 10.564        | 2,419,156  | 1.1 |  |
| ケネディクスレジデンシャル      | 6.589         | 2,124,952 | 0.9 |  | ヘルスケア&メディカル投資     | 3.58          | 383,060    | 0.2 |  |
| A P I 投資法人         | 12.556        | 5,844,818 | 2.6 |  | サムティ・レジデンシャル      | 5.045         | 451,527    | 0.2 |  |
| G L P 投資法人         | 50.861        | 6,179,611 | 2.7 |  | ジャパン・シニアリビング      | 1.6           | 255,040    | 0.1 |  |
| コンフォリア・レジデンシャル     | 10.595        | 2,552,335 | 1.1 |  | 野村不動産マスターF        | 83.345        | 11,809,986 | 5.3 |  |
| 日本プロロジスリート         | 36.539        | 8,809,552 | 3.9 |  | いちごホテルリート投資       | 4.592         | 547,366    | 0.2 |  |
| 星野リゾート・リート         | 4.411         | 2,487,804 | 1.1 |  | ラサールロジポート投資       | 21.916        | 2,474,316  | 1.1 |  |
| Oneリート投資法人         | 3.176         | 759,064   | 0.3 |  | スターアジア不動産投        | 6.033         | 654,580    | 0.3 |  |
| イオンリート投資           | 27.588        | 3,225,037 | 1.4 |  | マリモ地方創生リート        | 1.622         | 185,394    | 0.1 |  |
| ヒューリックリート投資法       | 19.729        | 3,261,203 | 1.5 |  | 三井不ロジパーク          | 4.698         | 1,688,931  | 0.8 |  |
| 日本リート投資法人          | 7.805         | 2,630,285 | 1.2 |  | 大江戸温泉リート          | 3.755         | 324,807    | 0.1 |  |



ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

| フ   ァ   ン   ド   名 | 2017年11月30日現在 |            |             |
|-------------------|---------------|------------|-------------|
|                   | □   数         | 評   価   額  | 比   率       |
|                   | 千□            | 千円         | %           |
| さくら総合リート          | 6.984         | 641,131    | 0.3         |
| 投資法人みらい           | 3.696         | 658,996    | 0.3         |
| 森トラスト・ホテルリート投     | 6.292         | 886,542    | 0.4         |
| 三菱地所物流REIT        | 2.693         | 740,305    | 0.3         |
| 日本ビルファンド          | 28.133        | 15,838,879 | 7.0         |
| ジャパンリアルエステイト      | 27.46         | 14,993,160 | 6.7         |
| 日本リートルファンド        | 55.888        | 11,138,478 | 5.0         |
| オリックス不動産投資        | 56.049        | 8,838,927  | 3.9         |
| 日本プライムリアルティ       | 18.341        | 6,923,727  | 3.1         |
| プレミア投資法人          | 26.24         | 2,770,944  | 1.2         |
| 東急リアル・エステート       | 19.478        | 2,705,494  | 1.2         |
| グローバル・ワン不動産投資法人   | 4.664         | 1,884,256  | 0.8         |
| ユナイテッド・アーバン投資法人   | 64.073        | 10,206,828 | 4.5         |
| 森トラスト総合リート        | 20.763        | 3,405,132  | 1.5         |
| インヴィンシブル投資法人      | 79.677        | 3,836,447  | 1.7         |
| フロンティア不動産投資       | 9.882         | 4,516,074  | 2.0         |
| 平和不動産リート          | 18.091        | 1,689,699  | 0.8         |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 19.353        | 4,015,747  | 1.8         |
| 福岡リート投資法人         | 14.1          | 2,380,080  | 1.1         |
| ケネディクス・オフィス投資法人   | 8.492         | 5,366,944  | 2.4         |
| 積水ハウス・レジデンシャル投資法人 | 22.026        | 2,493,343  | 1.1         |
| いちごオフィスリート投資法人    | 22.495        | 1,763,608  | 0.8         |
| 大和証券オフィス投資法人      | 6.265         | 3,483,340  | 1.5         |
| 阪急リート投資法人         | 11.905        | 1,558,364  | 0.7         |
| スターツプロシード投資法人     | 4.577         | 762,070    | 0.3         |
| 大和ハウスリート投資法人      | 29.879        | 8,049,402  | 3.6         |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人  | 83.849        | 6,556,991  | 2.9         |
| 日本賃貸住宅投資法人        | 32.677        | 2,712,191  | 1.2         |
| ジャパンエクセレント投資法人    | 26.015        | 3,512,025  | 1.6         |
| 合   計             | □ 数 、 金 額     | 1,178,566  | 220,601,199 |
|                   | 銘柄数<比率>       | 59銘柄       | <98.2%>     |

(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。

(2) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

| 銘                      柄                      別 | 2017年11月30日現在                                   |                                                 |
|-------------------------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------------------|
|                                                 | 買                      建                      額 | 売                      建                      額 |
| 国内                                              | 百万円                                             | 百万円                                             |
| 東証ＲＥＩＴ                                          | 3,623                                           | －                                               |

(注) 単位未満は切捨て。

# ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

## 運用報告書 第27期（決算日 2017年9月15日）

（計算期間 2017年3月16日～2017年9月15日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの第27期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|            |                                                                                                                                                                                                                                                     |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針       | 東京証券取引所が算出・公表する「東証ＲＥＩＴ指数」（配当込み、以下同じ。）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。                                                                                                                                                                                        |
| 主要投資対象     | わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券                                                                                                                                                                                               |
| 運用方法       | ①東京証券取引所が算出・公表する「東証ＲＥＩＴ指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。<br>②投資成果を「東証ＲＥＩＴ指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証ＲＥＩＴ指数」の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。<br>③運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 |
| 投資信託証券組入制限 | 無制限                                                                                                                                                                                                                                                 |

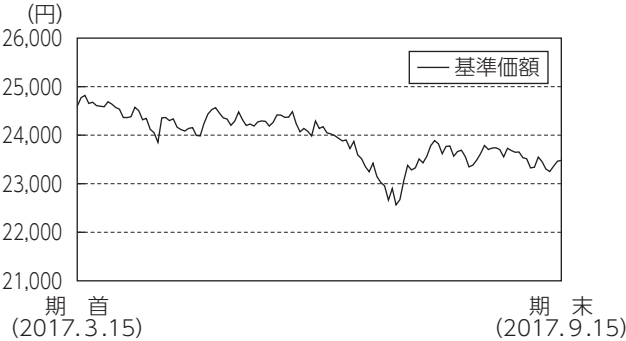
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日          | 基 準 価 額 |        | 東証ＲＥＩＴ指数(配当込み) |        | 投資信託証券組入比率 | 不動産投信指数先物比率 |
|----------------|---------|--------|----------------|--------|------------|-------------|
|                | 円       | 騰 落 率  | (ベンチマーク)       | 騰 落 率  |            |             |
| (期首)2017年3月15日 | 24,597  | %<br>— | 3,316.21       | %<br>— | %<br>98.6  | %<br>1.3    |
| 3月末            | 24,535  | △0.3   | 3,307.66       | △0.3   | 98.6       | 1.3         |
| 4月末            | 23,996  | △2.4   | 3,234.60       | △2.5   | 98.5       | 1.4         |
| 5月末            | 24,265  | △1.3   | 3,271.22       | △1.4   | 98.5       | 1.4         |
| 6月末            | 23,594  | △4.1   | 3,180.48       | △4.1   | 98.4       | 1.4         |
| 7月末            | 23,888  | △2.9   | 3,220.02       | △2.9   | 98.3       | 1.4         |
| 8月末            | 23,655  | △3.8   | 3,188.63       | △3.8   | 98.4       | 1.5         |
| (期末)2017年9月15日 | 23,482  | △4.5   | 3,165.38       | △4.5   | 98.5       | 1.5         |

(注1) 騰落率は期首比。  
(注2) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：24,597円 期末：23,482円 騰落率：△4.5%

【基準価額の主な変動要因】

東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざした運用を行なった結果、海外を中心に中期的な金利上昇への警戒感や、海外投資家および国内リートに投資する投資信託からの資金流出などを背景に、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は、期首より、海外を中心に中期的な金利上昇への警戒感が残っていることや、海外投資家や国内リートに投資する投資信託からの資金流出などを背景に、2017年7月にかけて下落基調で推移しました。その後、日米欧の金融政策イベントを通過したことによって先行き不透明感がやや薄れたことに加えて、国内リート市場の割安感が強まったこともあり一時反発しましたが、期末にかけては、北朝鮮に関わる地政学リスクが高まったことや投資信託からの資金流出などを背景に軟調に推移しました。

◆前期における「今後の運用方針」

当ファンドの運用の基本方針に基づき、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

◆ポートフォリオについて

東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）については、期を通じて99～100%程度としました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（東証ＲＥＩＴ指数（配当込み））の騰落率は△4.5%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△4.5%となりました。

ポートフォリオの騰落率と東証ＲＥＩＴ指数の騰落率の違い、先物取引の影響、売買等のコストが控除されたことが差異の要因となりました。

《今後の運用方針》

引き続き、当ファンドの運用の基本方針に基づき、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

■1万口当りの費用の明細

| 項 目             | 当 期       |
|-----------------|-----------|
| 売買委託手数料<br>(先物) | 0円<br>(0) |
| (投資信託証券)        | (0)       |
| 有価証券取引税         | —         |
| その他費用           | —         |
| 合 計             | 0         |

(注1) 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、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2017年3月16日から2017年9月15日まで)

|    | 買 付    |            | 売 付            |                   |
|----|--------|------------|----------------|-------------------|
|    | □ 数    | 金 額        | □ 数            | 金 額               |
|    | 千口     | 千円         | 千口             | 千円                |
| 国内 | 59.705 | 11,622,204 | 207.726<br>(-) | 38,895,277<br>(-) |

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2017年3月16日から2017年9月15日まで)

| 種 類 別 |             | 買 建          |              | 売 建      |          |
|-------|-------------|--------------|--------------|----------|----------|
|       |             | 新規買付額        | 決 済 額        | 新規売付額    | 決 済 額    |
| 国内    | 不動産投信指数先物取引 | 百万円<br>7,359 | 百万円<br>7,437 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託証券

(2017年3月16日から2017年9月15日まで)

| 当                |   |       |           |         | 期               |   |        |           |         |
|------------------|---|-------|-----------|---------|-----------------|---|--------|-----------|---------|
| 買                |   | 付     |           |         | 売               |   | 付      |           |         |
| 銘                | 柄 | □ 数   | 金 額       | 平均単価    | 銘               | 柄 | □ 数    | 金 額       | 平均単価    |
|                  |   | 千口    | 千円        | 円       |                 |   | 千口     | 千円        | 円       |
| 森トラスト・ホテルリート投    |   | 7.736 | 1,155,087 | 149,313 | 日本ビルファンド        |   | 4.333  | 2,536,649 | 585,425 |
| ジャパンリアルエステイト     |   | 1.637 | 963,299   | 588,453 | ジャパンリアルエステイト    |   | 4.139  | 2,363,076 | 570,929 |
| 大和ハウスリート投資法人     |   | 3.202 | 910,186   | 284,255 | 野村不動産マスターＦ      |   | 12.838 | 2,005,058 | 156,181 |
| 日本リテールファンド       |   | 3.804 | 828,077   | 217,686 | 大和証券オフィス投資法人    |   | 3.277  | 1,827,282 | 557,608 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 |   | 9.541 | 745,761   | 78,163  | 日本リテールファンド      |   | 8.422  | 1,777,967 | 211,109 |
| 日本プロロジスリート       |   | 2.965 | 690,814   | 232,989 | 日本プロロジスリート      |   | 7.126  | 1,700,253 | 238,598 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人  |   | 3.817 | 639,943   | 167,656 | 大和ハウスリート投資法人    |   | 6.011  | 1,660,313 | 276,212 |
| ケネディクス商業リート      |   | 2.434 | 594,335   | 244,180 | ユナイテッド・アーバン投資法人 |   | 9.657  | 1,579,868 | 163,598 |
| オリックス不動産投資       |   | 3.346 | 586,706   | 175,345 | オリックス不動産投資      |   | 8.45   | 1,412,918 | 167,209 |
| 日本ビルファンド         |   | 0.783 | 468,514   | 598,357 | G L P 投資法人      |   | 10.911 | 1,342,457 | 123,037 |

(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) 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

| フ   ア   ン   ド   名  | 当                      期                      末 |            |       |
|--------------------|-------------------------------------------------|------------|-------|
|                    | □                      数                        | 評   価   額  | 比   率 |
| 不動産投信              | 千口                                              | 千円         | %     |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 10.466                                          | 4,641,671  | 1.9   |
| MCUBS MidCity投資法人  | 6.375                                           | 2,071,875  | 0.9   |
| 森ヒルズリート            | 33.833                                          | 4,692,637  | 2.0   |
| 産業ファンド             | 8.556                                           | 4,166,772  | 1.7   |
| アドバンス・レジデンス        | 29.16                                           | 8,164,800  | 3.4   |
| ケネディクスレジデンシャル      | 7.143                                           | 2,020,754  | 0.8   |
| A P I 投資法人         | 13.612                                          | 6,601,820  | 2.7   |
| G L P 投資法人         | 55.139                                          | 6,451,263  | 2.7   |
| コンフォリア・レジデンシャル     | 11.486                                          | 2,724,479  | 1.1   |
| 日本プロロジスリート         | 39.615                                          | 9,654,175  | 4.0   |
| 星野リゾート・リート         | 3.916                                           | 2,177,296  | 0.9   |
| Oneリート投資法人         | 3.443                                           | 700,306    | 0.3   |
| イオンリート投資           | 27.908                                          | 3,150,813  | 1.3   |
| ヒューリックリート投資法       | 20.196                                          | 3,386,869  | 1.4   |
| 日本リート投資法人          | 8.462                                           | 2,623,220  | 1.1   |
| インベスコ・オフィス・Jリート    | 17.616                                          | 1,862,011  | 0.8   |
| 日本ヘルスケア投資法         | 1.527                                           | 246,610    | 0.1   |
| 積水ハウス・リート投資        | 19.756                                          | 2,562,353  | 1.1   |
| トーセイ・リート投資法人       | 3.957                                           | 421,816    | 0.2   |
| ケネディクス商業リート        | 11.452                                          | 2,740,463  | 1.1   |
| ヘルスケア&メディカル投資      | 3.881                                           | 371,799    | 0.2   |
| サムティ・レジデンシャル       | 5.469                                           | 457,208    | 0.2   |
| ジャパン・シニアリビング       | 1.734                                           | 233,396    | 0.1   |
| 野村不動産マスターF         | 90.355                                          | 13,002,084 | 5.4   |
| いちごホテルリート投資        | 4.978                                           | 533,641    | 0.2   |
| ラサールロジポート投資        | 23.76                                           | 2,556,576  | 1.1   |
| スターアジア不動産投         | 6.54                                            | 669,042    | 0.3   |
| マリモ地方創生リート         | 1.758                                           | 172,987    | 0.1   |
| 三井不ロジパーク           | 5.093                                           | 1,634,853  | 0.7   |
| 大江戸温泉リート           | 4.006                                           | 354,130    | 0.1   |
| さくら総合リート           | 7.571                                           | 667,005    | 0.3   |
| 投資法人みらい            | 4.007                                           | 688,402    | 0.3   |
| 森トラスト・ホテルリート投      | 6.821                                           | 993,819    | 0.4   |
| 日本ビルファンド           | 30.499                                          | 17,597,923 | 7.3   |
| ジャパンリアルエステイト       | 29.77                                           | 16,790,280 | 7.0   |
| 日本リテールファンド         | 60.589                                          | 12,408,627 | 5.2   |
| オリックス不動産投資         | 60.764                                          | 9,667,552  | 4.0   |
| 日本プライムリアルティ        | 19.884                                          | 7,705,050  | 3.2   |
| プレミアム投資法人          | 28.447                                          | 3,063,741  | 1.3   |
| 東急リアル・エステート        | 21.116                                          | 2,871,776  | 1.2   |
| グローバル・ワン不動産投資法人    | 5.057                                           | 1,883,732  | 0.8   |
| ユナイテッド・アーバン投資法人    | 69.463                                          | 11,579,482 | 4.8   |
| 森トラスト総合リート         | 22.509                                          | 3,945,827  | 1.6   |

| フ   ア   ン   ド   名        | 当                      期                      末 |           |             |
|--------------------------|-------------------------------------------------|-----------|-------------|
|                          | □                      数                        | 評   価   額 | 比   率       |
|                          | 千口                                              | 千円        | %           |
| インヴィンシブル投資法人             | 70.226                                          | 3,202,305 | 1.3         |
| フロンティア不動産投資              | 10.714                                          | 5,008,795 | 2.1         |
| 平和不動産リート                 | 19.613                                          | 1,749,479 | 0.7         |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人        | 20.294                                          | 4,318,563 | 1.8         |
| 福岡リート投資法人                | 15.286                                          | 2,482,446 | 1.0         |
| ケネディクス・オフィス投資法人          | 9.206                                           | 5,762,956 | 2.4         |
| 積水ハウス・レジデンシャル投資法人        | 23.879                                          | 2,698,327 | 1.1         |
| いちごオフィスリート投資法人           | 24.388                                          | 1,802,273 | 0.8         |
| 大和証券オフィス投資法人             | 6.792                                           | 3,796,728 | 1.6         |
| 阪急リート投資法人                | 12.906                                          | 1,747,472 | 0.7         |
| スターツプロシード投資法人            | 4.963                                           | 749,413   | 0.3         |
| 大和ハウスリート投資法人             | 32.392                                          | 8,975,823 | 3.7         |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人         | 90.902                                          | 6,554,034 | 2.7         |
| 日本賃貸住宅投資法人               | 35.425                                          | 2,876,510 | 1.2         |
| ジャパンエクセレント投資法人           | 28.203                                          | 3,750,999 | 1.6         |
| 合                      計 | □ 数、金 額                                         | 1,252,878 | 236,387,072 |
|                          | 銘柄数<比率>                                         | 58銘柄      | <98.5%>     |

※森ヒルズリート、産業ファンド、アドバンス・レジデンス、A P I 投資法人、G L P 投資法人、コンフォリア・レジデンシャル、日本プロロジスリート、One リート投資法人、イオンリート投資、ヒューリックリート投資法人、日本ヘルスケア投資法人、積水ハウス・リート投資、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート、サムティ・レジデンシャル、三井不ロジパーク、さくら総合リート、日本ビルファンド、日本リテールファンド、オリックス不動産投資、日本プライムリアルティ、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、平和不動産リート、ケネディクス・オフィス投資法人、積水ハウス・レジデンシャル投資法人、大和証券オフィス投資法人、スターツプロシード投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人につきましては、各ファンドで開示されている直近の有価証券報告書または有価証券届出書において、当社の利害関係人等（投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される法人等をいいます。）である大和証券、大和リアル・エステート・アセット・マネジメント、ミカサ・アセット・マネジメントが当該ファンドの運用会社または一般事務受託会社となっています。（注1）合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。（注2）評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

| 銘                      柄                      別 | 当                      期                      末 |           |
|-------------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|
|                                                 | 買   建   額                                       | 売   建   額 |
| 国                      内                        | 百万円                                             | 百万円       |
| 東証 R E I T                                      | 3,590                                           | －         |

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年9月15日現在

| 項 目          | 当 期 末       |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評 価 額       | 比 率   |
|              | 千円          | %     |
| 投資信託証券       | 236,387,072 | 97.1  |
| コール・ローン等、その他 | 7,085,566   | 2.9   |
| 投資信託財産総額     | 243,472,638 | 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

2017年9月15日現在

| 項 目            | 当 期 末            |
|----------------|------------------|
| (A) 資産         | 243,858,413,364円 |
| コール・ローン等       | 2,067,135,087    |
| 投資信託証券(評価額)    | 236,387,072,100  |
| 未収入金           | 2,267,962,260    |
| 未収配当金          | 2,742,447,317    |
| 差入委託証拠金        | 393,796,600      |
| (B) 負債         | 3,751,177,844    |
| 未払金            | 5,003,744        |
| 未払解約金          | 3,360,399,100    |
| 差入委託証拠金代用有価証券  | 385,775,000      |
| (C) 純資産総額(A－B) | 240,107,235,520  |
| 元本             | 102,250,435,372  |
| 次期繰越損益金        | 137,856,800,148  |
| (D) 受益権総口数     | 102,250,435,372口 |
| 1万口当り基準価額(C／D) | 23,482円          |

\* 期首における元本額は115,884,390,053円、当期中における追加設定元本額は3,090,413,466円、同解約元本額は16,724,368,147円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン10,122,905,091円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）85,549,171,019円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）388,457,942円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 22,838円、i F r e e Ｊ－ＲＥＩＴインデックス71,505,958円、i F r e e 8 資産バランス239,037,208円、ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン3,503,939,694円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 3,627,740円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 5,975,034円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 1,058,851円、ダイワ・ノーロード Ｊ－ＲＥＩＴファンド62,958,287円、ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス634,777,004円、ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワSMA専用）1,418,852円、ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス181,673,999円、ダイワ・インデックスセレクト Ｊ－ＲＥＩＴ1,483,905,855円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は23,482円です。

■損益の状況

当期 自2017年3月16日 至2017年9月15日

| 項 目                      | 当 期              |
|--------------------------|------------------|
| (A) 配当等収益                | 4,911,461,392円   |
| 受取配当金                    | 4,912,149,677    |
| 支払利息                     | △ 688,285        |
| (B) 有価証券売買損益             | △ 17,413,806,167 |
| 売買益                      | 945,058,278      |
| 売買損                      | △ 18,358,864,445 |
| (C) 先物取引等損益              | △ 167,655,776    |
| 取引損                      | △ 167,655,776    |
| (D) その他費用                | △ 9,680          |
| (E) 当期損益金(A + B + C + D) | △ 12,670,010,231 |
| (F) 前期繰越損益金              | 169,155,585,698  |
| (G) 解約差損益金               | △ 22,995,917,453 |
| (H) 追加信託差損益金             | 4,367,142,134    |
| (I) 合計(E + F + G + H)    | 137,856,800,148  |
| 次期繰越損益金(I)               | 137,856,800,148  |

(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。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                        |
|--------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 商品分類         | 追加型投信／海外／不動産投信（リート）                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                        |
| 信託期間         | 無期限                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                        |
| 運用方針         | 海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                        |
| 主要投資対象       | ベビーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券                                                                       |
|              | ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。） |
| ベビーファンドの運用方法 | ①主として、マザーファンドの受益証券に投資し、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。<br>②保有実質外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。<br>※保有実質外貨建資産とは、当ファンドが保有する外貨建資産およびマザーファンドが保有する外貨建資産のうち当ファンドに属するとみなした外貨建資産をいいます。<br>③運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。        |                                                                                                        |
| マザーファンドの運用方法 | ①主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。<br>②組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。<br>③運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>④保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。 |                                                                                                        |
| 組入制限         | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 無制限                                                                                                    |
|              | マザーファンドの投資信託証券組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                        |
| 分配方針         | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。                                                                                                                                                                                 |                                                                                                        |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワファンドラップオンライン  
外国ＲＥＩＴインデックス  
（為替ヘッジあり）

運用報告書（全体版）  
第１期

（決算日 2017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。

さて、「ダイワファンドラップオンライン外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）」は、このたび、第１期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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）

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



設定以来の運用実績

| 決 算 期              | 基 準 価 額     |            |                | S & P 先進国 R E I T 指数<br>(除く日本) (現地通貨ベース) |          | 投資信託<br>受益証券<br>組入比率 | 投 資<br>信託証券<br>組入比率 | 不 動 産<br>投信指数<br>先物比率 | 純 資 産<br>総 額 |
|--------------------|-------------|------------|----------------|------------------------------------------|----------|----------------------|---------------------|-----------------------|--------------|
|                    |             | 税 込<br>分 配 | み 金<br>期 騰 落 率 | (参考指数)                                   | 期 騰 落 率  |                      |                     |                       |              |
| 1 期末 (2017年11月30日) | 円<br>10,301 | 円<br>0     | %<br>3.0       | 10,550                                   | %<br>5.5 | %<br>0.3             | %<br>97.6           | %<br>0.5              | 百万円<br>451   |

(注 1) S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (現地通貨ベース) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。同指数は、S & P ダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスである S & P グローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとの R E I T 制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。同指数の所有権およびその他一切の権利は、S&P Dow Jones Indices LLCが有しています。S&P Dow Jones Indices LLCは、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。

(注 2) 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。

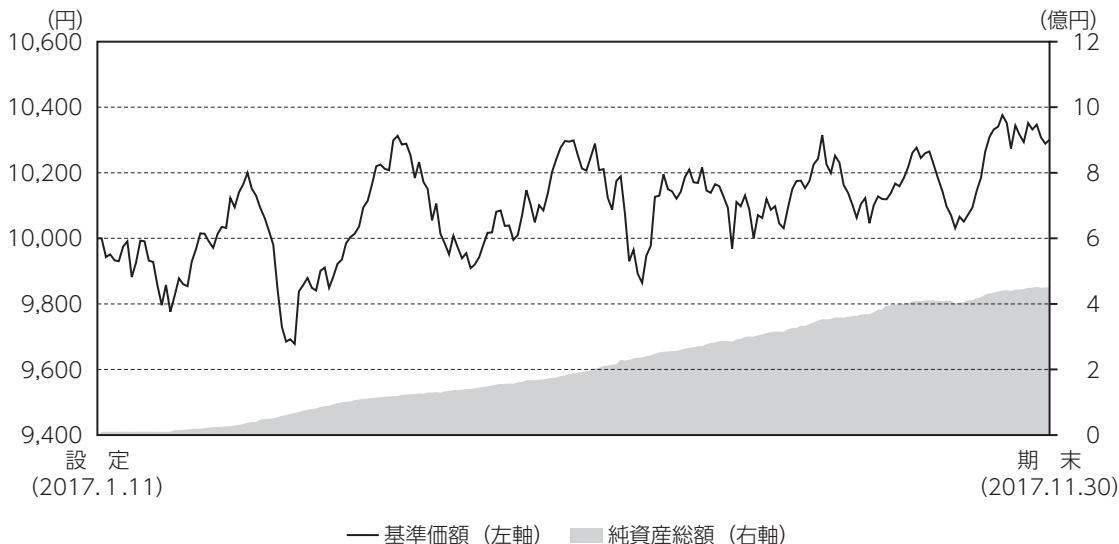
(注 3) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注 4) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



#### ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：10,301円

騰落率：3.0%

#### ■基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートに投資し、為替ヘッジした結果、海外リート市況が米国等で上昇した影響が大きく、当ファンドの基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

| 年<br>月<br>日       | 基 準 価 額     |        | S & P 先進国 R E I T 指数<br>(除く日本) (現地通貨ベース) |        | 投 資 信 託<br>受 益 証 券<br>組 入 比 率 | 投 信 託 証 券<br>組 入 比 率 | 不 動 産<br>投 信 指 数 |
|-------------------|-------------|--------|------------------------------------------|--------|-------------------------------|----------------------|------------------|
|                   | 騰 落 率       |        | (参考指数)                                   | 騰 落 率  |                               |                      |                  |
| (設定) 2017年 1 月11日 | 円<br>10,000 | %<br>－ | 10,000                                   | %<br>－ | %<br>－                        | %<br>－               | %<br>－           |
| 1 月末              | 9,796       | △2.0   | 9,804                                    | △2.0   | －                             | 97.4                 | －                |
| 2 月末              | 10,200      | 2.0    | 10,276                                   | 2.8    | －                             | 98.6                 | －                |
| 3 月末              | 9,935       | △0.7   | 10,006                                   | 0.1    | －                             | 98.2                 | －                |
| 4 月末              | 10,151      | 1.5    | 10,245                                   | 2.4    | －                             | 98.7                 | －                |
| 5 月末              | 9,995       | △0.1   | 10,103                                   | 1.0    | －                             | 99.0                 | －                |
| 6 月末              | 10,124      | 1.2    | 10,265                                   | 2.7    | －                             | 100.3                | －                |
| 7 月末              | 10,171      | 1.7    | 10,335                                   | 3.4    | 0.3                           | 98.1                 | －                |
| 8 月末              | 10,092      | 0.9    | 10,275                                   | 2.7    | 0.2                           | 98.8                 | －                |
| 9 月末              | 10,100      | 1.0    | 10,297                                   | 3.0    | 0.6                           | 100.4                | －                |
| 10月末              | 10,051      | 0.5    | 10,269                                   | 2.7    | 0.4                           | 98.7                 | 0.6              |
| (期末) 2017年11月30日  | 10,301      | 3.0    | 10,550                                   | 5.5    | 0.3                           | 97.6                 | 0.5              |

(注) 騰落率は設定比。

## 投資環境について

（2017.1.11～2017.11.30）

### ■海外リート市況

北米リート市況は、設定時より、トランプ米国大統領の政策に対する市場の思惑から方向感が定まらない動きとなりましたが、2017年2月には住宅用および貸倉庫用不動産の堅調な決算発表等を受け上昇しました。3月には、長期金利が上昇ペースを速めたことを受けて一時売られましたが、その後は、米国景気の底堅さやトランプ政権に対する政策期待などの好材料もある一方、利上げ懸念や対北朝鮮をはじめとした地政学リスクもあって方向感のない動きとなりました。期末にかけては、米国経済の先行きに楽観的な見方が強まったことや、長期金利の上昇が一服したことなどを受け、上昇しました。

欧州リート市況は、設定時から、長期金利の影響を受けた一進一退の値動きとなりました。2017年4月から5月にかけては、フランス大統領選挙の結果を受けた安心感から大きく上昇しました。その後は、英国の総選挙の結果を受けて政策の不透明感が高まったことや、ドイツを中心とした長期金利上昇が嫌気され下落する局面はあったものの、期末にかけてはやや買い戻される展開となりました。

アジア・オセアニアリート市況は、設定時より、香港およびシンガポールは自国金利が低下に転じたことなどを好感し、その後も、上昇を続ける中国株式市場の影響やリートの好業績期待から、堅調に推移しました。オーストラリアは、2017年6月にはテナント売り上げの減少懸念があった商業リートを中心に売られる局面はあったものの、主要リートの好業績等もあり、期末にかけて堅調に推移しました。

## ポートフォリオについて

（2017.1.11～2017.11.30）

### ■当ファンド

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資を90～110%の範囲で行ないました。また、マザーファンド保有外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないました。

なお、マザーファンドの組入比率が100%程度にならないのは、為替の売りヘッジ予約による評価損益が発生する影響が主要因です。

### ■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエートで組成し、ベンチマーク（Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース））との連動性を維持するような運用を行ないました。

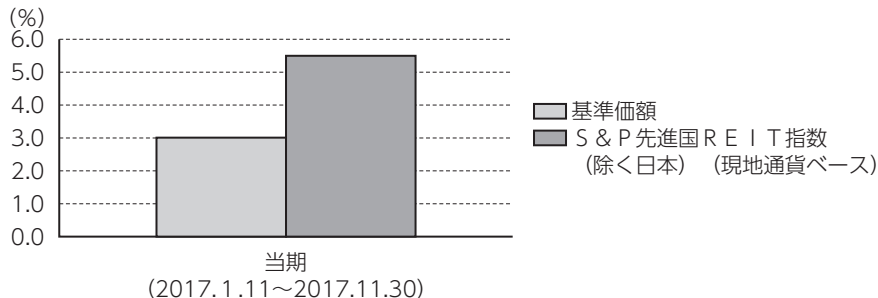
また、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ＥＴＦ）および不動産投信指数先物を組み入れました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。

マザーファンドについては、配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。



## 分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目           | 当 期                        |  |
|---------------|----------------------------|--|
|               | 2017年1月11日<br>～2017年11月30日 |  |
| 当期分配金（税込み）（円） | —                          |  |
| 対基準価額比率（％）    | —                          |  |
| 当期の収益（円）      | —                          |  |
| 当期の収益以外（円）    | —                          |  |
| 翌期繰越分配対象額（円）  | 301                        |  |

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

引き続き「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。また、マザーファンドの保有外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

### ■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

今後の運用につきましては、引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ＥＴＦ）および不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

# 1 万口当りの費用の明細

| 項 目        | 当期<br>(2017.1.11~2017.11.30) |         | 項 目 の 概 要                                                          |
|------------|------------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------|
|            | 金 額                          | 比 率     |                                                                    |
| 信 託 報 酬    | 29円                          | 0.283%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は10,092円です。                       |
| (投 信 会 社)  | (22)                         | (0.216) | 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、目<br>論見書・運用報告書の作成等の対価         |
| (販 売 会 社)  | (5)                          | (0.048) | 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<br>の情報提供等の対価                |
| (受 託 銀 行)  | (2)                          | (0.019) | 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    | 2                            | 0.019   | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (先 物)      | (0)                          | (0.000) |                                                                    |
| (投資信託受益証券) | (0)                          | (0.000) |                                                                    |
| (投資信託証券)   | (2)                          | (0.018) |                                                                    |
| 有価証券取引税    | 3                            | 0.026   | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金   |
| (投資信託受益証券) | (0)                          | (0.000) |                                                                    |
| (投資信託証券)   | (3)                          | (0.026) |                                                                    |
| そ の 他 費 用  | 15                           | 0.147   | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数                                          |
| (保 管 費 用)  | (14)                         | (0.135) | 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・<br>資産の移転等に要する費用             |
| (監 査 費 用)  | (0)                          | (0.004) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                        |
| (そ の 他)    | (1)                          | (0.007) | 信託事務の処理等に関するその他の費用                                                 |
| 合 計        | 48                           | 0.474   |                                                                    |

(注 1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 比率欄は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して 100 を乗じたものです。



■売買および取引の状況  
親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

|                             | 設 定     |         | 解 約   |        |
|-----------------------------|---------|---------|-------|--------|
|                             | □ 数     | 金 額     | □ 数   | 金 額    |
|                             | 千□      | 千円      | 千□    | 千円     |
| ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド | 202,754 | 440,915 | 4,875 | 10,860 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

| 設定時保有額 | 期中設定額 | 期中解約額 | 期末保有額 | 取 引 の 理 由        |
|--------|-------|-------|-------|------------------|
| 百万円    | 百万円   | 百万円   | 百万円   |                  |
| 10     | －     | 10    | －     | 当初設定時における取得とその処分 |

(注1) 金額は元本ベース。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

| 種 類                         | 当 期 末   |         |
|-----------------------------|---------|---------|
|                             | □ 数     | 評 価 額   |
|                             | 千□      | 千円      |
| ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド | 197,879 | 445,227 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

| 項 目                         | 当 期 末   |       |
|-----------------------------|---------|-------|
|                             | 評 価 額   | 比 率   |
|                             | 千円      | %     |
| ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド | 445,227 | 98.5  |
| コール・ローン等、その他                | 6,772   | 1.5   |
| 投資信託財産総額                    | 452,000 | 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＝112.05円、１カナダ・ドル＝87.10円、１オーストラリア・ドル＝84.87円、１香港ドル＝14.35円、１シンガポール・ドル＝83.19円、１ニュージーランド・ドル＝76.68円、１イギリス・ポンド＝150.33円、１イスラエル・シェケル＝31.98円、１ユーロ＝132.81円です。  
(注3) ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（13,288,169千円）の投資信託財産総額（13,406,985千円）に対する比率は、99.1％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

| 項 目                              | 当 期 末        |
|----------------------------------|--------------|
| (A) 資産                           | 884,601,657円 |
| コール・ローン等                         | 873,830      |
| ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド(評価額) | 445,227,867  |
| 未収入金                             | 438,499,960  |
| (B) 負債                           | 433,350,424  |
| 未払金                              | 432,687,744  |
| 未払解約金                            | 215,748      |
| 未払信託報酬                           | 439,557      |
| その他未払費用                          | 7,375        |
| (C) 純資産総額(A－B)                   | 451,251,233  |
| 元本                               | 438,056,631  |
| 次期繰越損益金                          | 13,194,602   |
| (D) 受益権総口数                       | 438,056,631口 |
| 1万口当り基準価額(C／D)                   | 10,301円      |

\* 設定時における元本額は10,000,000円、当期中における追加設定元本額は464,575,492円、同解約元本額は36,518,861円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,301円です。

■損益の状況

当期 自2017年1月11日 至2017年11月30日

| 項 目                  | 当 期          |
|----------------------|--------------|
| (A) 配当等収益            | △ 319円       |
| 受取利息                 | 14           |
| 支払利息                 | △ 333        |
| (B) 有価証券売買損益         | 9,473,068    |
| 売買益                  | 28,616,913   |
| 売買損                  | △19,143,845  |
| (C) 信託報酬等            | △ 630,466    |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 8,842,283    |
| (E) 追加信託差損益金         | 4,352,319    |
| (配当等相当額)             | (△ 221)      |
| (売買損益相当額)            | ( 4,352,540) |
| (F) 合計(D + E)        | 13,194,602   |
| 次期繰越損益金(F)           | 13,194,602   |
| 追加信託差損益金             | 4,352,319    |
| (配当等相当額)             | (△ 221)      |
| (売買損益相当額)            | ( 4,352,540) |
| 分配準備積立金              | 8,842,602    |
| 繰越損益金                | △ 319        |

- (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「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■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        | 8,842,602    |
| (c) 収益調整金                  | 4,352,540    |
| (d) 分配準備積立金                | 0            |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 13,195,142   |
| (f) 分配金                    | 0            |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f)       | 13,195,142   |
| (h) 受益権総口数                 | 438,056,631口 |

《お知らせ》

■マザーファンドにおける先物取引の利用について

当ファンドの主要投資対象である「ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド」において、不動産投信指数先物取引を利用できるように約款を変更しました。

# ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第13期（決算日 2017年11月30日）

（計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日）

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの第13期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運 用 方 針                | S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行ないます。                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 主 要 投 資 対 象            | 海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）                                                                                                                                                                                                                   |
| 運 用 方 法                | ①主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。<br>②組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。<br>③運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>④保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。 |
| 投 資 信 託 証 券<br>組 入 制 限 | 無制限                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

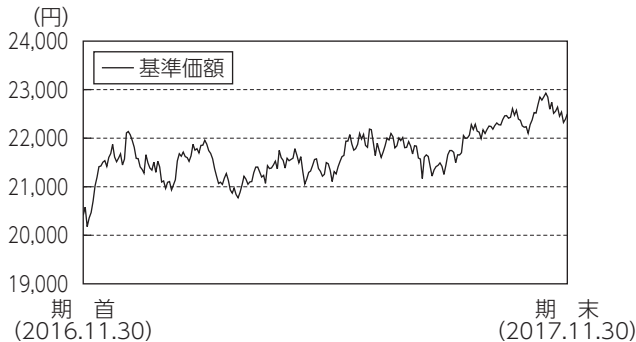
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

## ■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日           | 基 準 価 額 |      | S&P先進国REIT指数<br>(除く日本) (円ベース) |      | 投資信託<br>受益証券<br>組入比率 | 投資信託<br>証 券<br>組入比率 | 不動 産<br>投 信 指 数<br>先物比率 |
|-----------------|---------|------|-------------------------------|------|----------------------|---------------------|-------------------------|
|                 | 円       | %    | 騰落率                           | 騰落率  | %                    | %                   | %                       |
| (期首)2016年11月30日 | 20,411  | —    | 23,209                        | —    | —                    | —                   | 98.9                    |
| 12月末            | 21,569  | 5.7  | 24,465                        | 5.4  | —                    | —                   | 98.4                    |
| 2017年1月末        | 21,097  | 3.4  | 23,979                        | 3.3  | —                    | —                   | 98.9                    |
| 2月末             | 21,851  | 7.1  | 24,778                        | 6.8  | —                    | —                   | 99.2                    |
| 3月末             | 21,215  | 3.9  | 23,966                        | 3.3  | —                    | —                   | 99.0                    |
| 4月末             | 21,542  | 5.5  | 24,499                        | 5.6  | —                    | —                   | 98.9                    |
| 5月末             | 21,217  | 3.9  | 24,180                        | 4.2  | —                    | —                   | 99.6                    |
| 6月末             | 21,851  | 7.1  | 25,059                        | 8.0  | —                    | —                   | 99.1                    |
| 7月末             | 21,805  | 6.8  | 25,045                        | 7.9  | 0.3                  | 99.1                | —                       |
| 8月末             | 21,658  | 6.1  | 24,700                        | 6.4  | 0.2                  | 99.0                | —                       |
| 9月末             | 22,181  | 8.7  | 25,341                        | 9.2  | 0.6                  | 98.3                | —                       |
| 10月末            | 22,101  | 8.3  | 25,276                        | 8.9  | 0.4                  | 98.7                | 0.6                     |
| (期末)2017年11月30日 | 22,500  | 10.2 | 25,699                        | 10.7 | 0.3                  | 98.9                | 0.5                     |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) S & P先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース) は、S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスである S & Pグローバル株債指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとの R E I T 制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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

(注4) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

## 《運用経過》

### ◆基準価額等の推移について

#### 【基準価額・騰落率】

期首：20,411円 期末：22,500円 騰落率：10.2%

#### 【基準価額の主な変動要因】

海外リート市場の上昇が主な要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

### ◆投資環境について

#### ○海外リート市況

北米リート市況は、期首より、米国トランプ政権の景気刺激策への期待から緩やかな上昇となりました。2017年3月には、長期金利が上昇ペースを速めたことを受けて一時売られました。その後は、米国景気の底堅さやトランプ政権に対する政策期待などの好材料もある一方、利上げ懸念や対北朝鮮をはじめとした地政学リスクもあって方向感のない動きとなりました。期末にかけては、米国経

済の先行きに楽観的な見方が強まったことや、長期金利の上昇が一服したことなどを受け、上昇して期末を迎えました。

欧州リート市況は、期首から、長期金利の影響を受けた一進一退の値動きとなりました。2017年4月から5月にかけては、フランス大統領選挙の結果を受けた安心感から大きく上昇しました。その後は、英国の総選挙の結果を受けて政策の不透明感が高まったことや、ドイツを中心とした長期金利上昇が嫌気され下落する局面もあったものの、期末にかけてはやや買戻される展開となりました。

アジア・オセアニアリート市況は、期首より、香港およびシンガポールは長期金利上昇の影響や中国政府が不動産市場の投機抑制に動いたことから、軟調な推移となりました。2017年に入ると、目金金利が低下に転じたことなどを好感し、上昇基調となりました。その後も、上昇を続ける中国株式市場の影響やリートの好業績への期待から、堅調に推移しました。オーストラリアは、期首から、好調な国内景気を背景に買われました。2017年6月には、テナント売り上げの減少懸念があった商業リートを中心に売られる局面もあったものの、主要リートの好業績等もあり、期末にかけて堅調に推移しました。

### ○為替相場

為替相場は、期を通じてユーロなどの欧州の通貨が対円で上昇しました。

米ドルは、期首から、トランプ大統領の政策への期待と米国の年内追加利上げ観測の高まりによる日米金利差拡大を背景に上昇しました。2017年に入ると、トランプ政権が日本を含めた通貨安批判を行なったことを材料に緩やかな円高に転じました。4月後半からは、米国の金利高感が高まった局面では円安が進むものの、政治的リスクが高まった局面では円高となるボックス圏の推移となりました。

ユーロは、2017年3月にフランス大統領選挙の動向をにらんで一時的に売られましたが、最終的に E U (欧州連合) に肯定的な候補が大統領に選出されたことから、上昇に転じました。その後も、E C B (欧州中央銀行) が金融緩和姿勢を後退させたことから、ユーロは9月までは上昇を続けました。英ポンドは、E U 離脱による経済的な懸念が強まり2017年4月中旬までは英ポンド安が進みましたが、その後はユーロと同様に英ポンド高基調となりました。

オーストラリア・ドルは、2017年3月から4月にかけて資源価格の下落などで一時軟調な局面もあったものの、その後は相対的な高金利や資源価格が上昇に転じたことが好感されて、オーストラリア・ドル高となりました。期末にかけては、金利据え置き観測の高まりから下落する展開となりました。

### ◆前期における「今後の運用方針」

今後の運用につきましては、引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマーク (S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース)) に連動する投資成果をめざして運用を行います。リートの組入比率は、期を通じて原則として98%以上で運用を行います。また、保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

### ◆ポートフォリオについて

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウェイトで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行ないました。

また、運用の効率化を図るため、外国投資信託 (E T F) および不動産投信指数先物を組み入れました。

### ◆ベンチマークとの差異について

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

《今後の運用方針》

今後の運用につきましては、引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託（E T F）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

S & P先進国 R E I T 指数（除く日本）（「当インデックス」）は S & P Dow Jones Indices LLC（「S P D J I」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor's®および S & P®は Standard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが S P D J I に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

■ 1 万口当りの費用の明細

| 項 目        | 当 期  |
|------------|------|
| 売買委託手数料    | 6円   |
| （先物）       | (0)  |
| （投資信託受益証券） | (0)  |
| （投資信託証券）   | (5)  |
| 有価証券取引税    | 8    |
| （投資信託受益証券） | (0)  |
| （投資信託証券）   | (8)  |
| その他費用      | 42   |
| （保管費用）     | (43) |
| （その他）      | (△1) |
| 合 計        | 55   |

（注 1）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、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の（1 万口当りの費用の明細の項目の概要）をご参照ください。

（注 2）各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

|     |      | 買 付                |                          | 売 付              |                          |
|-----|------|--------------------|--------------------------|------------------|--------------------------|
|     |      | 口 数                | 金 額                      | 口 数              | 金 額                      |
| 外 国 | アメリカ | 千口<br>8.8<br>( - ) | 千アメリカ・ドル<br>735<br>( - ) | 千口<br>4<br>( - ) | 千アメリカ・ドル<br>331<br>( - ) |

（注 1）金額は受渡し代金。

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

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

（注 4）金額の単位未満は四捨捨て。

(2) 投資信託証券

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

|     |                  | 買 付                        |                                | 売 付                  |                             |
|-----|------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------|-----------------------------|
|     |                  | 口 数                        | 金 額                            | 口 数                  | 金 額                         |
| 外 国 | アメリカ             | 千口<br>1,440.1<br>(△ 4.826) | 千アメリカ・ドル<br>51,308<br>(△ 165)  | 千口<br>52<br>( - )    | 千アメリカ・ドル<br>1,993<br>( - )  |
|     | カナダ              | 千口<br>86.8<br>(△ 3.5)      | 千カナダ・ドル<br>1,625<br>(△ 74)     | 千口<br>3.3<br>( - )   | 千カナダ・ドル<br>14<br>( - )      |
|     | オーストラリア          | 千口<br>1,740.1<br>(△ 4.31)  | 千オーストラリア・ドル<br>7,125<br>(△ 28) | 千口<br>61.59<br>( - ) | 千オーストラリア・ドル<br>211<br>( - ) |
|     | 香港               | 千口<br>581.5<br>( - )       | 千香港ドル<br>10,029<br>( - )       | 千口<br>71.5<br>( - )  | 千香港ドル<br>319<br>( - )       |
|     | シンガポール           | 千口<br>2,075.9<br>( 35.275) | 千シンガポール・ドル<br>2,798<br>( 18)   | 千口<br>84.15<br>( - ) | 千シンガポール・ドル<br>104<br>( - )  |
|     | ニュージーランド         | 千口<br>294.06<br>( - )      | 千ニュージーランド・ドル<br>396<br>( - )   | 千口<br>35.31<br>( - ) | 千ニュージーランド・ドル<br>56<br>( - ) |
|     | イギリス             | 千口<br>908.86<br>( 38.843)  | 千イギリス・ポンド<br>2,957<br>(△ 7)    | 千口<br>69.79<br>( - ) | 千イギリス・ポンド<br>164<br>( - )   |
|     | イスラエル            | 千口<br>3.55<br>( - )        | 千イスラエル・シェケル<br>39<br>( - )     | 千口<br>-<br>( - )     | 千イスラエル・シェケル<br>-<br>( - )   |
|     | ユーロ<br>(アイルランド)  | 千口<br>95.7<br>( - )        | 千ユーロ<br>130<br>( - )           | 千口<br>-<br>( - )     | 千ユーロ<br>-<br>( - )          |
|     | ユーロ<br>(オランダ)    | 千口<br>12.61<br>(△ 10.369)  | 千ユーロ<br>266<br>( - )           | 千口<br>0.27<br>( - )  | 千ユーロ<br>10<br>( - )         |
| 国   | ユーロ<br>(ベルギー)    | 千口<br>6.04<br>( 0.238)     | 千ユーロ<br>422<br>( 13)           | 千口<br>1.29<br>( - )  | 千ユーロ<br>74<br>( - )         |
|     | ユーロ<br>(フランス)    | 千口<br>30.57<br>( 0.491)    | 千ユーロ<br>2,678<br>( 49)         | 千口<br>0.18<br>( - )  | 千ユーロ<br>37<br>( - )         |
|     | ユーロ<br>(ドイツ)     | 千口<br>12.91<br>( - )       | 千ユーロ<br>141<br>(△ 4)           | 千口<br>-<br>( - )     | 千ユーロ<br>-<br>( - )          |
|     | ユーロ<br>(スペイン)    | 千口<br>43.63<br>( - )       | 千ユーロ<br>490<br>(△ 5)           | 千口<br>13.34<br>( - ) | 千ユーロ<br>157<br>( - )        |
|     | ユーロ<br>(イタリア)    | 千口<br>67.57<br>( - )       | 千ユーロ<br>45<br>(△ 0)            | 千口<br>-<br>( - )     | 千ユーロ<br>-<br>( - )          |
|     | ユーロ<br>(ユーロ 通貨計) | 千口<br>269.03<br>(△ 9.64)   | 千ユーロ<br>4,175<br>( 53)         | 千口<br>15.08<br>( - ) | 千ユーロ<br>280<br>( - )        |

（注 1）金額は受渡し代金。

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

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

（注 4）金額の単位未満は四捨捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

| 種 類 別 | 買 建       |          | 売 建      |          |
|-------|-----------|----------|----------|----------|
|       | 新規買付額     | 決 済 額    | 新規売付額    | 決 済 額    |
| 外 国   | 百万円<br>72 | 百万円<br>- | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

（注 1）金額は受渡し代金。

（注 2）単位未満は四捨捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

| 当                        |   |     |        |       | 期                        |   |    |        |       |
|--------------------------|---|-----|--------|-------|--------------------------|---|----|--------|-------|
| 買                        |   | 付   |        |       | 売                        |   | 付  |        |       |
| 銘柄                       | 柄 | 口数  | 金額     | 平均単価  | 銘柄                       | 柄 | 口数 | 金額     | 平均単価  |
|                          |   | 千口  | 千円     | 円     |                          |   | 千口 | 千円     | 円     |
| VANGUARD REIT ETF (アメリカ) |   | 8.8 | 82,211 | 9,342 | VANGUARD REIT ETF (アメリカ) |   | 4  | 37,283 | 9,320 |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

| 当                                |   |      |         |        | 期                                   |   |       |        |        |
|----------------------------------|---|------|---------|--------|-------------------------------------|---|-------|--------|--------|
| 買                                |   | 付    |         |        | 売                                   |   | 付     |        |        |
| 銘柄                               | 柄 | 口数   | 金額      | 平均単価   | 銘柄                                  | 柄 | 口数    | 金額     | 平均単価   |
|                                  |   | 千口   | 千円      | 円      |                                     |   | 千口    | 千円     | 円      |
| SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)  |   | 19.5 | 372,163 | 19,085 | SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)     |   | 1.5   | 28,176 | 18,784 |
| PUBLIC STORAGE (アメリカ)            |   | 9.2  | 222,939 | 24,232 | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA (スペイン)  |   | 13.34 | 20,952 | 1,570  |
| PROLOGIS INC (アメリカ)              |   | 33   | 207,978 | 6,302  | MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I (アメリカ) |   | 15    | 20,301 | 1,353  |
| WELLTOWER INC (アメリカ)             |   | 22.8 | 178,226 | 7,816  | REGENCY CENTERS CORP (アメリカ)         |   | 2.2   | 16,089 | 7,313  |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ) |   | 8.6  | 177,118 | 20,595 | AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)    |   | 0.6   | 12,262 | 20,437 |
| UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)        |   | 6.18 | 168,889 | 27,328 | PUBLIC STORAGE (アメリカ)               |   | 0.5   | 11,960 | 23,920 |
| EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)        |   | 22.6 | 164,768 | 7,290  | PROLOGIS INC (アメリカ)                 |   | 1.7   | 11,209 | 6,593  |
| VENTAS INC (アメリカ)                |   | 21.7 | 156,882 | 7,229  | EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)           |   | 1.3   | 9,528  | 7,329  |
| BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)     |   | 9.3  | 133,440 | 14,348 | NEW YORK REIT INC (アメリカ)            |   | 7.7   | 8,452  | 1,097  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)  |   | 10.4 | 129,011 | 12,404 | WELLTOWER INC (アメリカ)                |   | 1     | 8,053  | 8,053  |

(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

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細  
(1) 外国投資信託受益証券

| ファンド名                       | 当期末 |          |        |     |
|-----------------------------|-----|----------|--------|-----|
|                             | 口数  | 評価額      |        | 比率  |
|                             |     | 外貨建金額    | 邦貨換算金額 |     |
|                             | 千口  | 千アメリカ・ドル | 千円     | %   |
| (アメリカ)<br>VANGUARD REIT ETF | 4.8 | 404      | 45,318 | 0.3 |

(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) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。  
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

| フ ァ ン ド 名                    | 当 期 末  |                       |         |     |
|------------------------------|--------|-----------------------|---------|-----|
|                              | 口 数    | 評 価 額<br>外貨建金額 邦貨換算金額 | 比 率     |     |
| <b>不動産ファンド</b>               |        |                       |         |     |
| (シンガポール)                     | 千口     | 千アメリカ・ドル              | 千円      | %   |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV  | 93.103 | 84                    | 9,441   | 0.1 |
| (アメリカ)                       |        |                       |         |     |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST      | 7.1    | 269                   | 30,239  | 0.2 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP  | 7.7    | 63                    | 7,109   | 0.1 |
| URBAN EDGE PROPERTIES        | 10.882 | 279                   | 31,336  | 0.2 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC   | 10.9   | 239                   | 26,845  | 0.2 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 14.2   | 2,584                 | 289,645 | 2.2 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 32.147 | 5,102                 | 571,756 | 4.3 |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 15.9   | 1,988                 | 222,788 | 1.7 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A   | 16.055 | 711                   | 79,676  | 0.6 |
| GGP INC                      | 63.977 | 1,497                 | 167,745 | 1.3 |
| VORNADO REALTY TRUST         | 17.664 | 1,358                 | 152,263 | 1.1 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 4.5    | 95                    | 10,659  | 0.1 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES  | 4.6    | 121                   | 13,658  | 0.1 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL         | 1.6    | 46                    | 5,161   | 0.0 |
| QTS REALTY TRUST INC-CL A    | 4.8    | 269                   | 30,194  | 0.2 |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 37.8   | 2,522                 | 282,676 | 2.1 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC   | 21.4   | 414                   | 46,494  | 0.3 |
| EPR PROPERTIES               | 6.5    | 439                   | 49,256  | 0.4 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH  | 1.7    | 19                    | 2,163   | 0.0 |
| CITY OFFICE REIT INC         | 2.1    | 28                    | 3,138   | 0.0 |
| GLOBAL NET LEASE INC         | 6.333  | 137                   | 15,384  | 0.1 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST  | 6.329  | 167                   | 18,757  | 0.1 |
| CHATHAM LODGING TRUST        | 4.5    | 102                   | 11,435  | 0.1 |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST     | 6      | 173                   | 19,409  | 0.1 |
| SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 2.2    | 90                    | 10,106  | 0.1 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 5.2    | 361                   | 40,471  | 0.3 |
| FOREST CITY REALTY TRUST- A  | 27.3   | 668                   | 74,883  | 0.6 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 10.9   | 214                   | 24,060  | 0.2 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 1.6    | 45                    | 5,123   | 0.0 |
| ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN | 2.213  | 20                    | 2,308   | 0.0 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 76.5   | 1,504                 | 168,607 | 1.3 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A     | 25.908 | 563                   | 63,169  | 0.5 |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST      | 15.995 | 454                   | 50,881  | 0.4 |
| CORESITE REALTY CORP         | 3.5    | 394                   | 44,174  | 0.3 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 15.9   | 565                   | 63,406  | 0.5 |
| RLJ LODGING TRUST            | 17.271 | 368                   | 41,316  | 0.3 |
| FARMLAND PARTNERS INC        | 2.9    | 26                    | 2,947   | 0.0 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST      | 18     | 326                   | 36,586  | 0.3 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 3.8    | 59                    | 6,625   | 0.0 |
| CYRUSONE INC                 | 9.3    | 557                   | 62,513  | 0.5 |
| KIMCO REALTY CORP            | 43.4   | 801                   | 89,819  | 0.7 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC      | 1.8    | 17                    | 1,938   | 0.0 |
| HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A | 20.45  | 624                   | 70,025  | 0.5 |
| WHITESTONE REIT              | 3      | 44                    | 5,011   | 0.0 |
| TIER REIT INC                | 4.5    | 89                    | 10,064  | 0.1 |
| WHEELER REAL ESTATE INVESTME | 0.237  | 2                     | 269     | 0.0 |
| MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | 3      | 33                    | 3,791   | 0.0 |

| フ ァ ン ド 名                    | 当 期 末  |                       |         |     |
|------------------------------|--------|-----------------------|---------|-----|
|                              | 口 数    | 評 価 額<br>外貨建金額 邦貨換算金額 | 比 率     |     |
|                              | 千口     | 千アメリカ・ドル              | 千円      | %   |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 20.4   | 725                   | 81,238  | 0.6 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 14.4   | 285                   | 32,028  | 0.2 |
| QUALITY CARE PROPERTIES      | 9.3    | 137                   | 15,422  | 0.1 |
| PARK HOTELS & RESORTS INC    | 14.3   | 413                   | 46,306  | 0.3 |
| COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A | 56.211 | 691                   | 77,470  | 0.6 |
| INVITATION HOMES INC         | 29.297 | 688                   | 77,176  | 0.6 |
| JBG SMITH PROPERTIES         | 9.232  | 307                   | 34,467  | 0.3 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC      | 4.6    | 133                   | 15,004  | 0.1 |
| CLIPPER REALTY INC           | 1.4    | 14                    | 1,600   | 0.0 |
| GLADSTONE LAND CORP          | 0.9    | 12                    | 1,357   | 0.0 |
| INFRAREIT INC                | 3.7    | 78                    | 8,830   | 0.1 |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC   | 18.36  | 134                   | 15,017  | 0.1 |
| CORECIVIC INC                | 11.824 | 276                   | 30,935  | 0.2 |
| STORE CAPITAL CORP           | 16.8   | 433                   | 48,548  | 0.4 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC  | 10     | 149                   | 16,796  | 0.1 |
| LIFE STORAGE INC             | 4.8    | 429                   | 48,125  | 0.4 |
| SELECT INCOME REIT           | 6.4    | 162                   | 18,164  | 0.1 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC    | 4.2    | 166                   | 18,702  | 0.1 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 7.782  | 81                    | 9,077   | 0.1 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUN-A | 3.1    | 67                    | 7,520   | 0.1 |
| PARAMOUNT GROUP INC          | 20.1   | 322                   | 36,080  | 0.3 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A  | 13.1   | 266                   | 29,870  | 0.2 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 8      | 248                   | 27,833  | 0.2 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC  | 12.4   | 283                   | 31,817  | 0.2 |
| STAG INDUSTRIAL INC          | 9.5    | 268                   | 30,113  | 0.2 |
| VENTAS INC                   | 36.579 | 2,343                 | 262,602 | 2.0 |
| CARETRUST REIT INC           | 7.203  | 132                   | 14,874  | 0.1 |
| GEO GROUP INC/THE            | 12.8   | 339                   | 38,079  | 0.3 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | 30.9   | 563                   | 63,153  | 0.5 |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME | 9.6    | 178                   | 20,050  | 0.2 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC   | 17.787 | 343                   | 38,485  | 0.3 |
| UMH PROPERTIES INC           | 2.9    | 45                    | 5,069   | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC            | 27.3   | 1,106                 | 123,949 | 0.9 |
| TERRENO REALTY CORP          | 5.4    | 203                   | 22,786  | 0.2 |
| VEREIT INC                   | 98.808 | 775                   | 86,910  | 0.7 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC    | 46.7   | 395                   | 44,268  | 0.3 |
| SUN COMMUNITIES INC          | 8.1    | 750                   | 84,144  | 0.6 |
| ACADIA REALTY TRUST          | 8.611  | 246                   | 27,643  | 0.2 |
| ALEXANDER'S INC              | 0.4    | 170                   | 19,086  | 0.1 |
| PROLOGIS INC                 | 55.046 | 3,640                 | 407,883 | 3.1 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 9.7    | 1,231                 | 138,001 | 1.0 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST      | 17.4   | 302                   | 33,846  | 0.3 |
| SAUL CENTERS INC             | 1      | 64                    | 7,203   | 0.1 |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES  | 15.945 | 92                    | 10,380  | 0.1 |
| MACK-CALI REALTY CORP        | 8.5    | 190                   | 21,324  | 0.2 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 9.4    | 860                   | 96,468  | 0.7 |
| COUSINS PROPERTIES INC       | 41.607 | 373                   | 41,865  | 0.3 |
| DDR CORP                     | 31.156 | 243                   | 27,299  | 0.2 |
| DUKE REALTY CORP             | 36.5   | 1,045                 | 117,173 | 0.9 |



| ファンド名                        | 当 期 末  |          |         |     |
|------------------------------|--------|----------|---------|-----|
|                              | 口 数    | 評 価 額    |         | 比 率 |
|                              |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |     |
|                              | 千口     | 千アメリカ・ドル | 千円      | %   |
| EASTGROUP PROPERTIES INC     | 3.4    | 318      | 35,647  | 0.3 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 6.767  | 1,676    | 187,801 | 1.4 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR   | 11.9   | 384      | 43,095  | 0.3 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 7.4    | 977      | 109,533 | 0.8 |
| GETTY REALTY CORP            | 2.803  | 79       | 8,954   | 0.1 |
| WELLTOWER INC                | 37.9   | 2,549    | 285,717 | 2.1 |
| HCP INC                      | 48.1   | 1,293    | 144,980 | 1.1 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC     | 10.6   | 537      | 60,253  | 0.5 |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 16.9   | 504      | 56,525  | 0.4 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC  | 12.3   | 402      | 45,081  | 0.3 |
| EQUITY COMMONWEALTH          | 12.375 | 375      | 42,056  | 0.3 |
| KILROY REALTY CORP           | 10.1   | 762      | 85,398  | 0.6 |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES     | 11.2   | 316      | 35,452  | 0.3 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 15     | 669      | 74,995  | 0.6 |
| LTC PROPERTIES INC           | 4.1    | 190      | 21,302  | 0.2 |
| LEXINGTON REALTY TRUST       | 22.4   | 234      | 26,278  | 0.2 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 11.728 | 1,199    | 134,369 | 1.0 |
| MACERICH CO/THE              | 11.2   | 719      | 80,606  | 0.6 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 8.9    | 797      | 89,393  | 0.7 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC    | 4.2    | 329      | 36,876  | 0.3 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 15.3   | 632      | 70,923  | 0.5 |
| REALTY INCOME CORP           | 28.317 | 1,570    | 176,001 | 1.3 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES  | 10.1   | 308      | 34,573  | 0.3 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST  | 6.6    | 79       | 8,903   | 0.1 |
| PUBLIC STORAGE               | 15.4   | 3,238    | 362,818 | 2.7 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA     | 2      | 264      | 29,639  | 0.2 |
| REGENCY CENTERS CORP         | 15.22  | 1,034    | 115,967 | 0.9 |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES  | 7.3    | 106      | 11,917  | 0.1 |
| ISTAR INC                    | 6.5    | 75       | 8,404   | 0.1 |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 9.1    | 228      | 25,603  | 0.2 |
| SL GREEN REALTY CORP         | 10.2   | 1,042    | 116,839 | 0.9 |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST    | 24.1   | 461      | 51,712  | 0.4 |
| TAUBMAN CENTERS INC          | 6.2    | 356      | 39,987  | 0.3 |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A     | 2.5    | 59       | 6,652   | 0.0 |
| UDR INC                      | 27.7   | 1,090    | 122,164 | 0.9 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 1.1    | 82       | 9,282   | 0.1 |
| WVP CAREY INC                | 11     | 782      | 87,634  | 0.7 |
| WASHINGTON REIT              | 7.8    | 252      | 28,308  | 0.2 |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS  | 12.4   | 409      | 45,850  | 0.3 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST    | 8.3    | 54       | 6,147   | 0.0 |
| AGREE REALTY CORP            | 2.6    | 128      | 14,394  | 0.1 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 20.25  | 542      | 60,809  | 0.5 |
| CUBESMART                    | 18.5   | 524      | 58,788  | 0.4 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 22.326 | 370      | 41,527  | 0.3 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 21.178 | 2,477    | 277,616 | 2.1 |
| CEDAR REALTY TRUST INC       | 6.9    | 41       | 4,685   | 0.0 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 13     | 1,105    | 123,902 | 0.9 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST     | 3.475  | 61       | 6,876   | 0.1 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST  | 10.1   | 61       | 6,858   | 0.1 |
| KITE REALTY GROUP TRUST      | 8.25   | 162      | 18,201  | 0.1 |

| ファンド名                        | 当 期 末            |                    |                     |         |
|------------------------------|------------------|--------------------|---------------------|---------|
|                              | 口 数              | 評 価 額              |                     | 比 率     |
|                              |                  | 外貨建金額              | 邦貨換算金額              |         |
|                              | 千口               | 千アメリカ・ドル           | 千円                  | %       |
| MONMOUTH REAL ESTATE INV COR | 7                | 124                | 13,898              | 0.1     |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC   | 1.5              | 40                 | 4,538               | 0.0     |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES  | 14               | 594                | 66,622              | 0.5     |
| EDUCATION REALTY TRUST INC   | 7.2              | 264                | 29,624              | 0.2     |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP    | 2.5              | 57                 | 6,479               | 0.0     |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO   | 20.442           | 225                | 25,287              | 0.2     |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 5.249            | 76                 | 8,545               | 0.1     |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 36.9             | 508                | 57,016              | 0.4     |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 9.7              | 104                | 11,705              | 0.1     |
| DOUGLAS EMMETT INC           | 15.5             | 624                | 69,957              | 0.5     |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC     | 9.5              | 570                | 63,974              | 0.5     |
| RETAIL PROPERTIES OF AME - A | 22.9             | 297                | 33,382              | 0.3     |
| アメリカ・ドル通貨計                   | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 2,337,492<br>158銘柄 | 84,388<br>9,455,753 | <70.9%> |
| (カナダ)                        | 千口               | 千カナダ・ドル            | 千円                  | %       |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 7.7              | 107                | 9,402               | 0.1     |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV | 8.9              | 103                | 9,007               | 0.1     |
| SLATE RETAIL REIT - U        | 1.7              | 22                 | 1,946               | 0.0     |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 3.5              | 48                 | 4,252               | 0.0     |
| AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA | 0.7              | 8                  | 719                 | 0.0     |
| SLATE OFFICE REIT            | 2.8              | 22                 | 1,990               | 0.0     |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 5.6              | 63                 | 5,560               | 0.0     |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI | 2.4              | 17                 | 1,546               | 0.0     |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 2.2              | 111                | 9,671               | 0.1     |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 2.5              | 21                 | 1,914               | 0.0     |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 3.5              | 31                 | 2,707               | 0.0     |
| CHOICE PROPERTIES REIT       | 4.3              | 56                 | 4,947               | 0.0     |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE  | 13.8             | 92                 | 8,017               | 0.1     |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 1.7              | 25                 | 2,179               | 0.0     |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 2.9              | 42                 | 3,702               | 0.0     |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 6.6              | 192                | 16,762              | 0.1     |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 6.8              | 251                | 21,920              | 0.2     |
| CAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 3.9              | 176                | 15,401              | 0.1     |
| COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 9.49             | 132                | 11,572              | 0.1     |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 14.266           | 299                | 26,069              | 0.2     |
| MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS  | 2.3              | 31                 | 2,772               | 0.0     |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TR | 16.1             | 400                | 34,861              | 0.3     |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 4.2              | 90                 | 7,883               | 0.1     |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 2                | 80                 | 6,980               | 0.1     |
| NORTHVIEW APARTMENT REAL EST | 2.3              | 57                 | 5,044               | 0.0     |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 3.7              | 50                 | 4,434               | 0.0     |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 4.8              | 199                | 17,408              | 0.1     |
| カナダ・ドル通貨計                    | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 140,656<br>27銘柄    | 2,740<br>238,677    | < 1.8%> |
| (オーストラリア)                    | 千口               | 千オーストラリア・ドル        | 千円                  | %       |
| FOLKESTONE EDUCATION TRUST   | 16.89            | 48                 | 4,157               | 0.0     |
| CROMWELL PROPERTY GROUP      | 119.72           | 123                | 10,465              | 0.1     |
| RURAL FUNDS GROUP            | 23.54            | 56                 | 4,774               | 0.0     |
| VIVA ENERGY REIT             | 39.3             | 85                 | 7,271               | 0.1     |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT  | 13.99            | 59                 | 5,010               | 0.0     |

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

| ファンド名                         | 当期末     |            |           |         |
|-------------------------------|---------|------------|-----------|---------|
|                               | 口数      | 評価額        |           | 比率      |
|                               |         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |         |
|                               | 千口      | オーストラリア・ドル | 千円        | %       |
| PROPERTYLINK GROUP            | 49.06   | 50         | 4,246     | 0.0     |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA  | 74.35   | 178        | 15,144    | 0.1     |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR  | 26.19   | 91         | 7,779     | 0.1     |
| NATIONAL STORAGE REIT         | 44.14   | 72         | 6,124     | 0.0     |
| INDUSTRIA REIT                | 11.76   | 30         | 2,604     | 0.0     |
| GDI PROPERTY GROUP            | 41.86   | 54         | 4,600     | 0.0     |
| SCENTRE GROUP                 | 553.46  | 2,341      | 198,692   | 1.5     |
| ARENA REIT                    | 27.01   | 67         | 5,730     | 0.0     |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS    | 10      | 32         | 2,749     | 0.0     |
| BWP TRUST                     | 45.99   | 146        | 12,412    | 0.1     |
| DEXUS                         | 105.66  | 1,078      | 91,556    | 0.7     |
| GPT GROUP                     | 184.96  | 989        | 83,981    | 0.6     |
| INVESTA OFFICE FUND           | 50.66   | 239        | 20,336    | 0.2     |
| CHARTER HALL RETAIL REIT      | 33.79   | 142        | 12,130    | 0.1     |
| MIRVAC GROUP                  | 381.83  | 931        | 79,070    | 0.6     |
| STOCKLAND                     | 250.6   | 1,172      | 99,536    | 0.7     |
| WESTFIELD CORP                | 199.18  | 1,665      | 141,320   | 1.1     |
| ABACUS PROPERTY GROUP         | 30.29   | 125        | 10,642    | 0.1     |
| GOODMAN GROUP                 | 165     | 1,437      | 121,970   | 0.9     |
| VICINITY CENTRES              | 336.69  | 935        | 79,438    | 0.6     |
| CHARTER HALL GROUP            | 46.45   | 291        | 24,757    | 0.2     |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP     | 16.33   | 45         | 3,839     | 0.0     |
| オーストラリア・ドル 通 貨 計              | 2,898.7 | 12,493     | 1,060,346 | < 8.0%> |
| (香港)                          | 千口      | 千香港ドル      | 千円        | %       |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN  | 103     | 535        | 7,685     | 0.1     |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST   | 91      | 486        | 6,986     | 0.1     |
| FORTUNE REIT                  | 140     | 1,358      | 19,487    | 0.1     |
| PROSPERITY REIT               | 124     | 409        | 5,872     | 0.0     |
| LINK REIT                     | 232     | 16,321     | 234,209   | 1.8     |
| SPRING REAL ESTATE INVESTMEN  | 74      | 256        | 3,674     | 0.0     |
| CHAMPION REIT                 | 196     | 1,136      | 16,313    | 0.1     |
| 香港ドル 通 貨 計                    | 960     | 20,503     | 294,227   | < 2.2%> |
| (シンガポール)                      | 千口      | 千シンガポール・ドル | 千円        | %       |
| KEPPEL DC REIT                | 74.028  | 106        | 8,868     | 0.1     |
| FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST | 53.4    | 73         | 6,086     | 0.0     |
| MAPLETREE GREATER CHINA COMM  | 175.5   | 203        | 16,935    | 0.1     |
| AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL   | 48.9    | 66         | 5,532     | 0.0     |
| FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI  | 120.3   | 129        | 10,808    | 0.1     |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST   | 269.975 | 502        | 41,774    | 0.3     |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT  | 251.3   | 660        | 54,981    | 0.4     |
| CAPITALAND MALL TRUST         | 274.5   | 565        | 47,041    | 0.4     |
| SUNTEC REIT                   | 229.3   | 458        | 38,150    | 0.3     |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST     | 211.9   | 266        | 22,211    | 0.2     |
| KEPPEL REIT                   | 184.7   | 230        | 19,206    | 0.1     |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST      | 52.76   | 75         | 6,320     | 0.0     |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST        | 134.3   | 158        | 13,183    | 0.1     |
| ESR-REIT                      | 84.479  | 47         | 3,970     | 0.0     |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS        | 76.4    | 124        | 10,359    | 0.1     |

| ファンド名                        | 当期末       |              |         |         |
|------------------------------|-----------|--------------|---------|---------|
|                              | 口数        | 評価額          |         | 比率      |
|                              |           | 外貨建金額        | 邦貨換算金額  |         |
|                              | 千口        | シンガポール・ドル    | 千円      | %       |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST    | 54.4      | 120          | 10,001  | 0.1     |
| STARHILL GLOBAL REIT         | 126.9     | 96           | 8,023   | 0.1     |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS | 51.1      | 84           | 7,014   | 0.1     |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE      | 36.3      | 103          | 8,636   | 0.1     |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL | 165.2     | 68           | 5,703   | 0.0     |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST   | 119.38    | 235          | 19,564  | 0.1     |
| CACHE LOGISTICS TRUST        | 100.2     | 86           | 7,168   | 0.1     |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   | 190.6     | 297          | 24,735  | 0.2     |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST   | 70.2      | 50           | 4,204   | 0.0     |
| SPH REIT                     | 70.5      | 74           | 6,158   | 0.0     |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REI | 64.9      | 42           | 3,536   | 0.0     |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 78.1      | 32           | 2,696   | 0.0     |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST   | 64.2      | 53           | 4,486   | 0.0     |
| QUE HOSPITALITY TRUST        | 96.673    | 79           | 6,594   | 0.0     |
| シンガポール・ドル 通 貨 計              | 3,530.395 | 5,096        | 423,954 | < 3.2%> |
| (ニュージーランド)                   | 千口        | 千ニュージーランド・ドル | 千円      | %       |
| STRIDE PROPERTY GROUP        | 29.16     | 51           | 3,980   | 0.0     |
| INVESTORE PROPERTY LTD       | 10.25     | 14           | 1,108   | 0.0     |
| ARGOSY PROPERTY LTD          | 71.63     | 75           | 5,767   | 0.0     |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD      | 145.35    | 198          | 15,213  | 0.1     |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 25.97     | 57           | 4,371   | 0.0     |
| GOODMAN PROPERTY TRUST       | 107.55    | 146          | 11,215  | 0.1     |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 100.59    | 132          | 10,181  | 0.1     |
| ニュージーランド・ドル 通 貨 計            | 490.5     | 676          | 51,837  | < 0.4%> |
| (イギリス)                       | 千口        | 千イギリス・ポンド    | 千円      | %       |
| ASSURA PLC                   | 185.42    | 109          | 16,473  | 0.1     |
| CAPITAL & REGIONAL PLC       | 41.94     | 21           | 3,231   | 0.0     |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 51.71     | 46           | 6,918   | 0.1     |
| REGIONAL REIT LTD            | 26.15     | 27           | 4,088   | 0.0     |
| NEWRIVER REIT PLC            | 31.4      | 99           | 14,939  | 0.1     |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC   | 13.45     | 15           | 2,259   | 0.0     |
| LXI REIT PLC                 | 11.54     | 12           | 1,804   | 0.0     |
| AEW UK LONG LEASE REIT PLC   | 7.57      | 7            | 1,165   | 0.0     |
| REDEFINE INTERNATIONAL PLC   | 110.39    | 41           | 6,166   | 0.0     |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    | 77.831    | 723          | 108,813 | 0.8     |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC        | 42.78     | 58           | 8,862   | 0.1     |
| SEGO PLC                     | 104.09    | 571          | 85,984  | 0.6     |
| HAMMERSON PLC                | 82.18     | 424          | 63,809  | 0.5     |
| UNITE GROUP PLC              | 24.52     | 176          | 26,466  | 0.2     |
| BRITISH LAND CO PLC          | 108.08    | 674          | 101,385 | 0.8     |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC   | 32.79     | 200          | 30,068  | 0.2     |
| INTU PROPERTIES PLC          | 87.71     | 170          | 25,672  | 0.2     |
| DERWENT LONDON PLC           | 11.52     | 313          | 47,122  | 0.4     |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES    | 56.76     | 65           | 9,812   | 0.1     |
| WORKSPACE GROUP PLC          | 12.28     | 114          | 17,195  | 0.1     |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC       | 20.18     | 93           | 14,045  | 0.1     |
| SHAFTESBURY PLC              | 23.03     | 227          | 34,188  | 0.3     |

| ファンド名                        | 当 期 末            |                   |                  |         |
|------------------------------|------------------|-------------------|------------------|---------|
|                              | 口 数              | 評 価 額             |                  | 比 率     |
|                              |                  | 外貨建金額             | 邦貨換算金額           |         |
|                              | 千口               | 千円                | 千円               | %       |
| BIG YELLOW GROUP PLC         | 15.46            | 129               | 19,406           | 0.1     |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC    | 70.52            | 126               | 19,082           | 0.1     |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 43.33            | 26                | 3,940            | 0.0     |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC      | 141.22           | 205               | 30,825           | 0.2     |
| (非上場)                        |                  |                   |                  |         |
| ASSURA PLC-ENT               | 33.712           | —                 | —                | —       |
| イギリス・ポンド通貨計                  | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,467,563<br>27銘柄 | 4,681<br>703,728 | < 5.3%> |
| (イスラエル)                      |                  |                   |                  |         |
| REIT 1 LTD                   | 千口               | 千イスラエル・シェケル       | 千円               | %       |
|                              | 9.34             | 140               | 4,480            | 0.0     |
| イスラエル・シェケル通貨計                | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 9.34<br>1銘柄       | 140<br>4,480     | < 0.0%> |
| ユーロ (アイルランド)                 | 千口               | 千ユーロ              | 千円               | %       |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 33.1             | 49                | 6,545            | 0.0     |
| GREEN REIT PLC               | 66.56            | 99                | 13,171           | 0.1     |
| HIBERNIA REIT PLC            | 70.99            | 100               | 13,340           | 0.1     |
| 国 小 計                        | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 170.65<br>3銘柄     | 248<br>33,057    | < 0.2%> |
| ユーロ (オランダ)                   | 千口               | 千ユーロ              | 千円               | %       |
| WERELDHAVE NV                | 4.15             | 161               | 21,473           | 0.2     |
| EUROCOMMERCIAL PROPRIET-CV   | 5.01             | 177               | 23,574           | 0.2     |
| NSI NV                       | 1.731            | 58                | 7,793            | 0.1     |
| VASTNED RETAIL NV            | 1.48             | 59                | 7,842            | 0.1     |
| 国 小 計                        | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 12,371<br>4銘柄     | 456<br>60,683    | < 0.5%> |
| ユーロ (ベルギー)                   | 千口               | 千ユーロ              | 千円               | %       |
| AEDIFICA                     | 1.808            | 144               | 19,221           | 0.1     |
| COFINIMMO                    | 1.97             | 212               | 28,282           | 0.2     |
| BEFIMMO                      | 2.31             | 123               | 16,425           | 0.1     |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 1.23             | 27                | 3,609            | 0.0     |
| RETAIL ESTATES               | 0.5              | 36                | 4,801            | 0.0     |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA       | 1.67             | 151               | 20,089           | 0.2     |
| 国 小 計                        | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 9,488<br>6銘柄      | 695<br>92,430    | < 0.7%> |
| ユーロ (フランス)                   | 千口               | 千ユーロ              | 千円               | %       |
| UNIBAIL-RODAMCO SE           | 10.4             | 2,260             | 300,278          | 2.3     |
| ICADE                        | 4.69             | 369               | 49,095           | 0.4     |
| ALTAREA                      | 0.35             | 67                | 8,989            | 0.1     |
| GECINA SA                    | 4.831            | 672               | 89,311           | 0.7     |
| KLEPIERRE                    | 21.62            | 748               | 99,377           | 0.7     |
| FONCIERE DES REGIONS         | 5.48             | 489               | 64,992           | 0.5     |
| MERCIALYS                    | 5.66             | 98                | 13,109           | 0.1     |
| 国 小 計                        | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 53,031<br>7銘柄     | 4,707<br>625,154 | < 4.7%> |
| ユーロ (ドイツ)                    | 千口               | 千ユーロ              | 千円               | %       |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG       | 12.69            | 158               | 21,007           | 0.2     |
| HAMBORNER REIT AG            | 8.12             | 78                | 10,409           | 0.1     |
| 国 小 計                        | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 20.81<br>2銘柄      | 236<br>31,417    | < 0.2%> |

| ファンド名                         | 当 期 末            |                     |                  |         |
|-------------------------------|------------------|---------------------|------------------|---------|
|                               | 口 数              | 評 価 額               |                  | 比 率     |
|                               |                  | 外貨建金額               | 邦貨換算金額           |         |
|                               | 千口               | 千ユーロ                | 千円               | %       |
| ユーロ (スペイン)                    |                  |                     |                  |         |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM  | 9.6              | 79                  | 10,592           | 0.1     |
| HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI  | 11.17            | 164                 | 21,799           | 0.2     |
| AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA   | 6.96             | 127                 | 16,906           | 0.1     |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA   | 34.56            | 379                 | 50,374           | 0.4     |
| 国 小 計                         | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 62.29<br>4銘柄        | 750<br>99,673    | < 0.7%> |
| ユーロ (イタリア)                    | 千口               | 千ユーロ                | 千円               | %       |
| BENI STABILI SPA              | 94.42            | 71                  | 9,524            | 0.1     |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZI | 30.4             | 32                  | 4,356            | 0.0     |
| 国 小 計                         | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 124.82<br>2銘柄       | 104<br>13,880    | < 0.1%> |
| ユーロ通貨計                        | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 453.46<br>28銘柄      | 7,200<br>956,298 | < 7.2%> |
| 合 計                           | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 12,288.106<br>311銘柄 | —<br>13,189,304  | <98.9%> |

(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) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。  
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

| 銘 柄 別                    | 当 期 末     |          |
|--------------------------|-----------|----------|
|                          | 買 建 額     | 売 建 額    |
| 外国                       |           |          |
| DJ US REIT IDXFTS (アメリカ) | 百万円<br>72 | 百万円<br>— |

(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

2017年11月30日現在

| 項 目          | 当 期 末      |       |
|--------------|------------|-------|
|              | 評 価 額      | 比 率   |
|              | 千円         | %     |
| 投資信託受益証券     | 45,318     | 0.3   |
| 投資信託証券       | 13,189,304 | 98.4  |
| コール・ローン等、その他 | 172,362    | 1.3   |
| 投資信託財産総額     | 13,406,985 | 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＝112.05円、1カナダ・ドル＝87.10円、1オーストラリア・ドル＝84.87円、1香港ドル＝14.35円、1シンガポール・ドル＝83.19円、1ニュージーランド・ドル＝76.68円、1イギリス・ポンド＝150.33円、1イスラエル・シェケル＝31.98円、1ユーロ＝132.81円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産（13,288,169千円）の投資信託財産総額（13,406,985千円）に対する比率は、99.1％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

| 項 目            | 当 期 末           |   |
|----------------|-----------------|---|
|                | 当               | 末 |
| (A) 資産         | 13,434,206,898円 |   |
| コール・ローン等       | 128,633,646     |   |
| 投資信託受益証券(評価額)  | 45,318,398      |   |
| 投資信託証券(評価額)    | 13,189,304,705  |   |
| 未収入金           | 27,764,698      |   |
| 未収配当金          | 29,756,258      |   |
| 差入委託証拠金        | 13,429,193      |   |
| (B) 負債         | 96,531,802      |   |
| 未払金            | 91,221,802      |   |
| 未払解約金          | 5,310,000       |   |
| (C) 純資産総額(A－B) | 13,337,675,096  |   |
| 元本             | 5,927,845,320   |   |
| 次期繰越損益金        | 7,409,829,776   |   |
| (D) 受益権総口数     | 5,927,845,320口  |   |
| 1万口当り基準価額(C／D) | 22,500円         |   |

\* 期首における元本額は2,563,048,197円、当期中における追加設定元本額は3,788,132,970円、同解約元本額は423,335,847円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり）3,020,027,986円、ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし）385,272,511円、ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり）197,879,052円、ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし）138,768,817円、D－I’s グローバル R E I T インデックス1,191,716円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 28,535円、iFree 外国 R E I T インデックス61,854,354円、iFree 8資産バランス305,935,202円、D Cダイワ・グローバル R E I T インデックスファンド1,494,626,508円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 3,528,717円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 6,075,115円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 1,124,043円、ダイワ・インデックスセレクト グローバル R E I T 280,050,632円、ダイワ・ノーロード グローバル R E I T ファンド 22,439,317円、ダイワ外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり）(ダイワ S M A 専用) 4,479,909円、ダイワ外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし）(ダイワ S M A 専用) 4,562,906円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は22,500円です。

■損益の状況

当期 自2016年12月1日 至2017年11月30日

| 項 目                      | 当 期           |   |
|--------------------------|---------------|---|
|                          | 当             | 期 |
| (A) 配当等収益                | 373,343,266円  |   |
| 受取配当金                    | 373,355,931   |   |
| 受取利息                     | 27,447        |   |
| 支払利息                     | △ 40,112      |   |
| (B) 有価証券売買損益             | 485,032,529   |   |
| 売買益                      | 900,668,253   |   |
| 売買損                      | △ 415,635,724 |   |
| (C) 先物取引等損益              | 392,175       |   |
| 取引益                      | 392,175       |   |
| (D) その他費用                | △ 19,421,346  |   |
| (E) 当期損益金(A + B + C + D) | 839,346,624   |   |
| (F) 前期繰越損益金              | 2,668,328,775 |   |
| (G) 解約差損益金               | △ 499,757,653 |   |
| (H) 追加信託差損益金             | 4,401,912,030 |   |
| (I) 合計(E + F + G + H)    | 7,409,829,776 |   |
| 次期繰越損益金(I)               | 7,409,829,776 |   |

(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》

■先物取引の利用について

不動産投信指数先物取引を利用できるように約款を変更しました。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                        |
|--------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 商 品 分 類      | 追加型投信／海外／不動産投信（リート）／インデックス型                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                        |
| 信 託 期 間      | 無期限                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                        |
| 運 用 方 針      | 投資成果をS＆P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行います。                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                        |
| 主要投資対象       | ベビーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券                                                                       |
|              | ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。） |
| ベビーファンドの運用方法 | 運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                        |
| マザーファンドの運用方法 | ①主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S＆P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。<br>②組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。<br>③運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>④保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。 |                                                                                                        |
| 組 入 制 限      | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 無制限                                                                                                    |
|              | マザーファンドの投資信託証券組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                        |
| 分 配 方 針      | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。                                                                                                                                                                                |                                                                                                        |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワファンドラップオンライン  
外国REITインデックス  
（為替ヘッジなし）

運用報告書（全体版）  
第1期  
（決算日 2017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。

さて、「ダイワファンドラップオンライン外国REITインデックス（為替ヘッジなし）」は、このたび、第1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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）

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

設定以来の運用実績

| 決 算 期              | 基 準 価 額     |        |              | S & P先進国REIT指数<br>(除く日本) (円ベース) |              | 投資信託<br>受益証券<br>組入比率 | 投 資<br>信託証券<br>組入比率 | 不 動 産<br>投信指数<br>先物比率 | 純 資 産<br>総 額 |
|--------------------|-------------|--------|--------------|---------------------------------|--------------|----------------------|---------------------|-----------------------|--------------|
|                    | 税 込<br>分 配  | み 金    | 期 中<br>騰 落 率 | (ベンチマーク)                        | 期 中<br>騰 落 率 |                      |                     |                       |              |
| 1 期末 (2017年11月30日) | 円<br>10,273 | 円<br>0 | %<br>2.7     | 10,407                          | %<br>4.1     | %<br>0.3             | %<br>98.9           | %<br>0.5              | 百万円<br>312   |

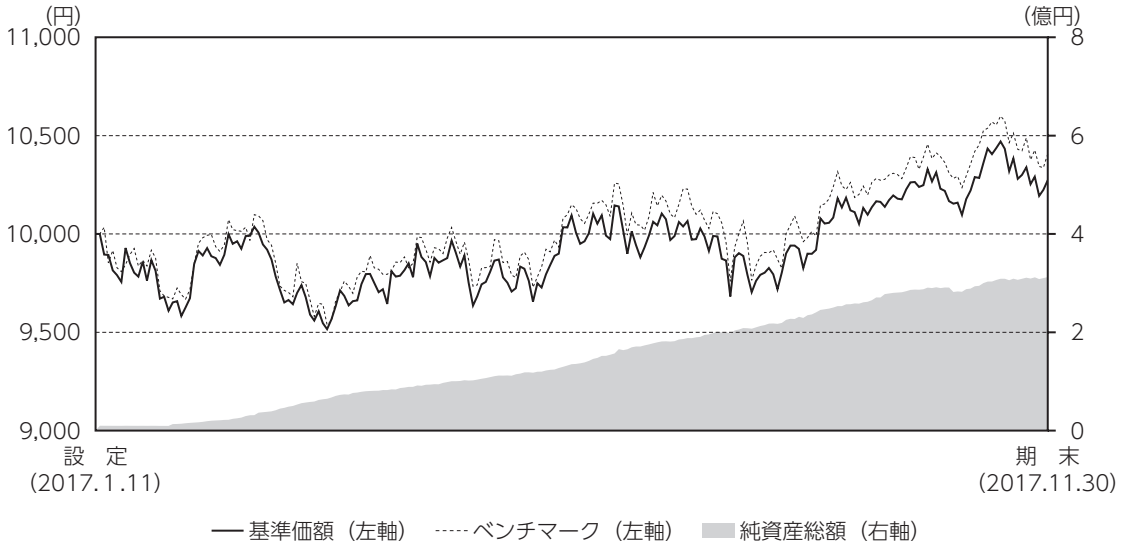
- (注 1) S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。
- (注 2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注 3) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
- (注 4) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (「当インデックス」) はS&P Dow Jones Indices LLC (「SPDJI」) の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor's<sup>®</sup>およびS & P<sup>®</sup>はStandard & Poor's Financial Services LLC (「S & P」) の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup>はDow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行なわず、S & P 先進国REIT指数 (除く日本) の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、設定時を10,000として指数化したものです。

\*ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）です。

#### ■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：10,273円

騰落率：2.7%

#### ■基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、海外リート市場の上昇が主な要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。



ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス (為替ヘッジなし)

| 年<br>月<br>日       | 基 準 価 額     |          | S & P先進国REIT指数<br>(除く日本) (円ベース) |        | 投 資 信 託<br>受 益 証 券<br>組 入 比 率 | 投 信 託 証 券<br>組 入 比 率 | 不 動 産<br>投 信 指 数 |
|-------------------|-------------|----------|---------------------------------|--------|-------------------------------|----------------------|------------------|
|                   | 騰 落 率       | (ベンチマーク) | 騰 落 率                           | 率      |                               |                      |                  |
| (設定) 2017年 1 月11日 | 円<br>10,000 | %<br>－   | 10,000                          | %<br>－ | %<br>－                        | %<br>－               | %<br>－           |
| 1 月末              | 9,671       | △3.3     | 9,710                           | △2.9   | －                             | 98.9                 | －                |
| 2 月末              | 9,989       | △0.1     | 10,034                          | 0.3    | －                             | 99.1                 | －                |
| 3 月末              | 9,713       | △2.9     | 9,705                           | △2.9   | －                             | 99.0                 | －                |
| 4 月末              | 9,857       | △1.4     | 9,921                           | △0.8   | －                             | 98.9                 | －                |
| 5 月末              | 9,707       | △2.9     | 9,792                           | △2.1   | －                             | 99.6                 | －                |
| 6 月末              | 9,992       | △0.1     | 10,148                          | 1.5    | －                             | 99.1                 | －                |
| 7 月末              | 9,971       | △0.3     | 10,142                          | 1.4    | 0.3                           | 99.1                 | －                |
| 8 月末              | 9,901       | △1.0     | 10,002                          | 0.0    | 0.2                           | 99.0                 | －                |
| 9 月末              | 10,136      | 1.4      | 10,262                          | 2.6    | 0.6                           | 98.2                 | －                |
| 10月末              | 10,097      | 1.0      | 10,236                          | 2.4    | 0.4                           | 98.7                 | 0.6              |
| (期末) 2017年11月30日  | 10,273      | 2.7      | 10,407                          | 4.1    | 0.3                           | 98.9                 | 0.5              |

(注) 騰落率は設定比。

## 投資環境について

(2017.1.11～2017.11.30)

### ■海外リート市況

北米リート市況は、設定時より、トランプ米国大統領の政策に対する市場の思惑から方向感が定まらない動きとなりましたが、2017年2月には住宅用および貸倉庫用不動産の堅調な決算発表等を受け上昇しました。3月には、長期金利が上昇ペースを速めたことを受けて一時売られましたが、その後は、米国景気の底堅さやトランプ政権に対する政策期待などの好材料もある一方、利上げ懸念や対北朝鮮をはじめとした地政学リスクもあって方向感のない動きとなりました。期末にかけては、米国経済の先行きに楽観的な見方が強まったことや、長期金利の上昇が一服したことなどを受け、上昇しました。

欧州リート市況は、設定時から、長期金利の影響を受けた一進一退の値動きとなりました。2017年4月から5月にかけては、フランス大統領選挙の結果を受けた安心感から大きく上昇しました。その後は、英国の総選挙の結果を受けて政策の不透明感が高まったことや、ドイツを中心とした長期金利上昇が嫌気され下落する局面はあったものの、期末にかけてはやや買い戻される展開となりました。

アジア・オセアニアリート市況は、設定時より、香港およびシンガポールは自国金利が低下に転じたことなどを好感し、その後も、上昇を続ける中国株式市場の影響やリートの好業績期待から、堅調に推移しました。オーストラリアは、2017年6月にはテナント売り上げの減少懸念があった商業リートを中心に売られる局面はあったものの、主要リートの好業績等もあり、期末にかけて堅調に推移しました。

### ■為替相場

為替相場は、ユーロなどの欧州の通貨が対円で上昇したものの、米ドルなどは対円で下落しました。

米ドルは、設定時より、トランプ政権が日本を含めた通貨安批判を行なったことを材料に緩やかな円高となりました。2017年4月後半からは、米国の金利先高感が強まった局面では円安が進むものの、政治的リスクが高まった局面では円高となるボックス圏の推移となりました。

ユーロは、2017年3月にフランス大統領選挙の動向をにらんで一時的に売られましたが、最終的にEU（欧州連合）に肯定的な候補が大統領に選出されたことから、上昇に転じました。その後も、ECB（欧州中央銀行）が金融緩和姿勢を後退させたことから、ユーロは9月までは上昇を続けました。英ポンドは、EU離脱による経済的な懸念が強まり2017年4月中旬までは英ポンド安が進みましたが、その後はユーロと同様に英ポンド高基調となりました。

オーストラリア・ドルは、2017年3月から4月にかけて資源価格の下落などで一時軟調な局面はあったものの、その後は相対的な高金利や資源価格が上昇に転じたことが好感されて、オーストラリア・ドル高となりました。期末にかけては金利据え置き観測の高まりから下落する展開となりました。

ポートフォリオについて

(2017.1.11～2017.11.30)

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行ないました。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエイトで組成し、ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））との連動性を維持するような運用を行ないました。

また、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ETF）および不動産投信指数先物を組み入れました。

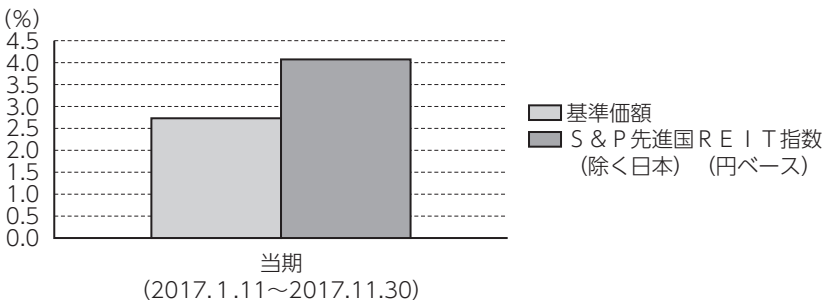
ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））の騰落率は4.1%となりました。当ファンドの基準価額の騰落率は2.7%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



## 分配金について

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

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項 目        |     | 当 期                        |
|------------|-----|----------------------------|
|            |     | 2017年1月11日<br>～2017年11月30日 |
| 当期分配金（税込み） | (円) | —                          |
| 対基準価額比率    | (%) | —                          |
| 当期の収益      | (円) | —                          |
| 当期の収益以外    | (円) | —                          |
| 翌期繰越分配対象額  | (円) | 311                        |

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

今後の運用につきましては、引き続き、主として「ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

### ■ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド

今後の運用につきましては、引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託（E T F）および不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目        | 当期<br>(2017.1.11～2017.11.30) |          | 項 目 の 概 要                                                          |
|------------|------------------------------|----------|--------------------------------------------------------------------|
|            | 金 額                          | 比 率      |                                                                    |
| 信 託 報 酬    | 28円                          | 0.283%   | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br><b>期中の平均基準価額は9,938円です。</b>                 |
| (投 信 会 社)  | (21)                         | (0.216)  | 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、目<br>論見書・運用報告書の作成等の対価         |
| (販 売 会 社)  | (5)                          | (0.048)  | 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<br>の情報提供等の対価                |
| (受 託 銀 行)  | (2)                          | (0.019)  | 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    | 2                            | 0.019    | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (先 物)      | (0)                          | (0.000)  |                                                                    |
| (投資信託受益証券) | (0)                          | (0.000)  |                                                                    |
| (投資信託証券)   | (2)                          | (0.019)  |                                                                    |
| 有価証券取引税    | 3                            | 0.026    | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金   |
| (投資信託受益証券) | (0)                          | (0.000)  |                                                                    |
| (投資信託証券)   | (3)                          | (0.026)  |                                                                    |
| そ の 他 費 用  | 14                           | 0.139    | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数                                          |
| (保 管 費 用)  | (14)                         | (0.137)  | 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・<br>資産の移転等に要する費用             |
| (監 査 費 用)  | (0)                          | (0.004)  | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                        |
| (そ の 他)    | (△0)                         | (△0.003) | スピンオフに係る税金の戻り、信託事務の処理等に関するその他の費用                                   |
| 合 計        | 46                           | 0.466    |                                                                    |

(注 1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 比率欄は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して 100 を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2017年1月11日から2017年11月30日まで)

|                                  | 設 定     |         | 解 約   |       |
|----------------------------------|---------|---------|-------|-------|
|                                  | □ 数     | 金 額     | □ 数   | 金 額   |
|                                  | 千□      | 千円      | 千□    | 千円    |
| ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド | 142,049 | 308,936 | 3,280 | 7,299 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

| 設定時保有額 | 期中設定額 | 期中解約額 | 期末保有額 | 取 引 の 理 由        |
|--------|-------|-------|-------|------------------|
| 百万円    | 百万円   | 百万円   | 百万円   |                  |
| 10     | －     | 10    | －     | 当初設定時における取得とその処分 |

(注1) 金額は元本ベース。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

| 種 類                              | 当 期 末   |         |
|----------------------------------|---------|---------|
|                                  | □ 数     | 評 価 額   |
|                                  | 千□      | 千円      |
| ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド | 138,768 | 312,229 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

| 項 目                              | 当 期 末   |       |
|----------------------------------|---------|-------|
|                                  | 評 価 額   | 比 率   |
|                                  | 千円      | %     |
| ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド | 312,229 | 99.8  |
| コール・ローン等、その他                     | 525     | 0.2   |
| 投資信託財産総額                         | 312,755 | 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＝112.05円、1 カナダ・ドル＝87.10円、1 オーストラリア・ドル＝84.87円、1 香港ドル＝14.35円、1 シンガポール・ドル＝83.19円、1 ニュージーランド・ドル＝76.68円、1 イギリス・ポンド＝150.33円、1 イスラエル・シケル＝31.98円、1 ユーロ＝132.81円です。

(注3) ダイワ・グローバル R E I T 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（13,288,169千円）の投資信託財産総額（13,406,985千円）に対する比率は、99.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

| 項 目                                   | 当 期 末        |
|---------------------------------------|--------------|
| (A) 資産                                | 312,755,661円 |
| コール・ローン等                              | 525,823      |
| ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド(評価額) | 312,229,838  |
| (B) 負債                                | 464,049      |
| 未払解約金                                 | 150,636      |
| 未払信託報酬                                | 308,264      |
| その他未払費用                               | 5,149        |
| (C) 純資産総額(A－B)                        | 312,291,612  |
| 元本                                    | 303,982,175  |
| 次期繰越損益金                               | 8,309,437    |
| (D) 受益権総口数                            | 303,982,175口 |
| 1万口当り基準価額(C／D)                        | 10,273円      |

\* 設定時における元本額は10,000,000円、当期中における追加設定元本額は323,203,250円、同解約元本額は29,221,075円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,273円です。

■ 損益の状況

当期 自2017年1月11日 至2017年11月30日

| 項 目                  | 当 期           |
|----------------------|---------------|
| (A) 配当等収益            | △ 62円         |
| 受取利息                 | 1             |
| 支払利息                 | △ 63          |
| (B) 有価証券売買損益         | 9,908,173     |
| 売買益                  | 10,608,981    |
| 売買損                  | △ 700,808     |
| (C) 信託報酬等            | △ 431,375     |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 9,476,736     |
| (E) 追加信託差損益金         | △ 1,167,299   |
| (配当等相当額)             | (△ 3)         |
| (売買損益相当額)            | (△ 1,167,296) |
| (F) 合計(D + E)        | 8,309,437     |
| 次期繰越損益金(F)           | 8,309,437     |
| 追加信託差損益金             | △ 1,167,299   |
| (配当等相当額)             | (△ 3)         |
| (売買損益相当額)            | (△ 1,167,296) |
| 分配準備積立金              | 9,476,798     |
| 繰越損益金                | △ 62          |

- (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「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■ 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        | 9,476,798    |
| (c) 収益調整金                  | 0            |
| (d) 分配準備積立金                | 0            |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 9,476,798    |
| (f) 分配金                    | 0            |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f)       | 9,476,798    |
| (h) 受益権総口数                 | 303,982,175口 |

《お知らせ》

■マザーファンドにおける先物取引の利用について

当ファンドの主要投資対象である「ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド」において、不動産投信指数先物取引を利用できるように約款を変更しました。

「ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド」の第13期にかかる運用状況については271～279ページをご参照ください。