★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	無期限	
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	下記の各マザーファンドの受益証券
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券（上場予定および店頭登録予定を含みます。）
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。）
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。）
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
ベビーファンドの運用方法	主として、マザーファンドを通じて内外の公社債、不動産投資信託証券および株式に投資を行ない、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。	
組入制限	株式組入上限比率	
	外国債券インデックスマザーファンド	純資産総額の30%以下
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	純資産総額の10%以下
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	無制限
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	
	投資信託証券組入上限比率	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	無制限
	ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行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。

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

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

運用報告書（全体版）
第12期
（決算日　2018年１月10日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ＤＣダイワ・ワールドアセット」は、このたび、第12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/

<3719>
<3720>
<3721>

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

最近５期の運用実績

決算期	基準価額			合成指数		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
8期末(2014年1月10日)	13,008	0	23.6	13,415	24.0	17.6	0.2	49.9	－	29.3	1,780
9期末(2015年1月13日)	15,471	0	18.9	16,024	19.4	16.4	0.2	49.7	－	30.9	2,254
10期末(2016年1月12日)	14,830	0	△ 4.1	15,393	△ 3.9	15.8	－	51.9	－	29.1	2,390
11期末(2017年1月10日)	15,563	0	4.9	16,490	7.1	17.5	－	49.7	－	29.7	2,765
12期末(2018年1月10日)	16,400	0	5.4	17,340	5.2	17.7	0.5	49.9	－	28.8	3,190

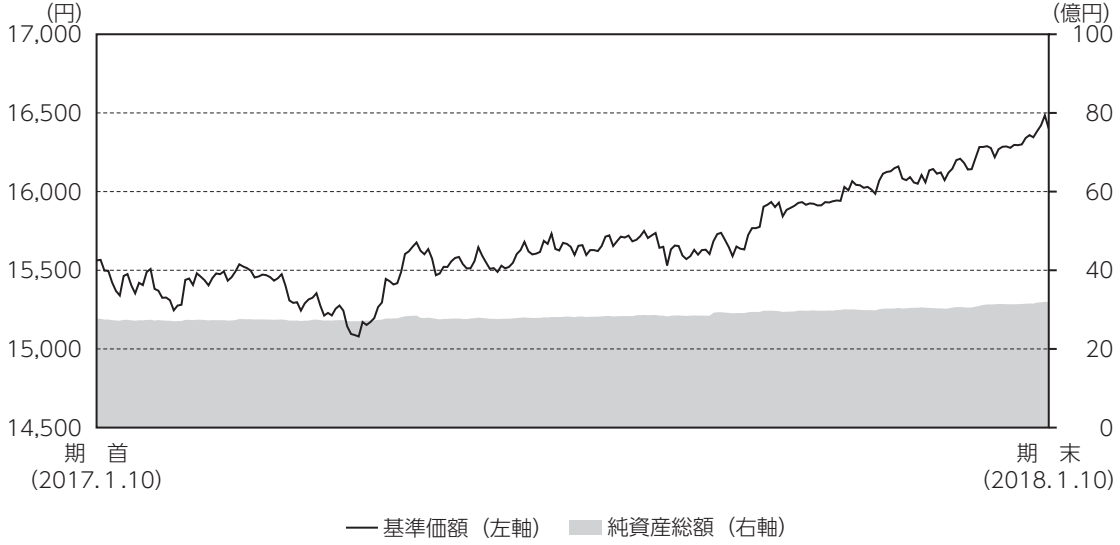
（注１）合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

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

（注２）組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
（注３）株式先物比率は買建比率－売建比率です。
（注４）公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

運用経過

基準価額等の推移について



■基準価額・騰落率

期　首：15,563円
期　末：16,400円
騰落率：5.4%

■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	4.6%	24.5%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	△0.0%	24.6%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	10.4%	14.7%
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	△4.0%	15.0%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	16.2%	6.9%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	16.7%	2.6%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	22.2%	0.5%
ダイワ好配当日本株マザーファンド	29.6%	10.4%

■基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、内外の株式や海外リ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。

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

年　　月　　日	基準価額		合成指数		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率					
	円	%		%	%	%	%	%	%
(期首)2017年１月10日	15,563	－	16,490	－	17.5	－	49.7	－	29.7
１月末	15,382	△1.2	16,255	△1.4	17.6	0.0	50.0	－	29.2
２月末	15,456	△0.7	16,358	△0.8	17.3	0.0	50.5	－	29.2
３月末	15,354	△1.3	16,226	△1.6	17.2	－	50.4	－	28.9
４月末	15,410	△1.0	16,303	△1.1	17.5	－	50.4	－	28.9
５月末	15,512	△0.3	16,419	△0.4	17.2	－	50.2	－	29.0
６月末	15,636	0.5	16,587	0.6	17.4	－	50.6	－	28.9
７月末	15,684	0.8	16,636	0.9	17.4	0.1	50.2	－	29.3
８月末	15,730	1.1	16,643	0.9	16.6	0.2	50.4	－	28.8
９月末	15,910	2.2	16,851	2.2	17.5	0.2	50.3	－	28.9
10月末	15,986	2.7	16,942	2.7	17.4	0.5	50.4	－	28.9
11月末	16,145	3.7	17,111	3.8	17.2	0.3	50.2	－	29.2
12月末	16,345	5.0	17,304	4.9	17.6	0.3	50.2	－	28.9
(期末)2018年１月10日	16,400	5.4	17,340	5.2	17.7	0.5	49.9	－	28.8

（注）騰落率は期首比。

投資環境について　(2017.1.11～2018.1.10)

■海外債券市況

主要国の国債金利は、期を通じて米国やドイツなどで上昇しました。期首より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（カナダ中央銀行）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。しかしその後は、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年内の追加利上げ観測の高まりなどを背景に金利は上昇し、その後の金利はレンジ内での推移が続きました。12月中旬以降は、米国で税制改革法が成立したことを背景に市場のリスク選好度が高まり、主要国の金利は上昇しました。

■国内債券市況

国内債券市場は、2017年１月に米国の利上げ観測などから海外の金利が上昇し、国内の長期金利も上昇しました。その後、長期金利はおおむねレンジ内で推移していましたが、４月には、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、国内の長期金利は低下しました。５月以降は、フランス大統領選挙の結果を受けて欧州の政治リスクへの懸念が後退したことなどから、海外の金利の上昇に連れて国内の金利も上昇しました。７月以降は、北朝鮮の地政学リスクの高まりを受けたリスク回避姿勢が再び強まったことなどから、金利は低下しました。９月以降は、米国の2017年内の追加利上げ観測の高まりなどを背景に海外の金利が上昇したことを受けて、国内の金利も上昇しました。11月に入ると、日銀の金融緩和策の長期化観測などから長期金利は低下し、その後はレンジ内での推移となりました。2018年１月には、金融緩和策の縮小観測などから長期金利は上昇しました。

■海外リート市況

海外リート市況は、地域別でまちまちの展開となりました。

米国では、長期金利の低下などを受けて買われる局面もありましたが、商業施設リートに対する業績懸念や、法人税の減税を柱とした税制改革法案が可決されたことを受けた長期金利の上昇が嫌気されたことで反落し、レンジでの推移となりました。

欧州では、英国はアジアの投資家からの旺盛な投資需要が支援材料となり、フランスなど大陸欧州も、政治リスクへの懸念が後退したことや大手商業施設リートに対する買収報道などを好感して底堅い展開が続きました。

アジア・オセアニアでは、中国の景気見通しの改善や主要リートの好業績への期待から、香港を中心に総じて堅調に推移しました。

■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たことや、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、北朝鮮の核開発に関する地政学リスクが高まったことや米国の長期金利上昇、また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。

■海外株式市況

・北米

北米株式市況は、朝鮮半島情勢などの地政学リスクの高まりなどを受けて調整する局面も見られましたが、良好な企業決算の発表や欧州の政治リスクの後退などが支援材料となり、堅調な推移となりました。2017年９月以降は、ハリケーンが勢力を弱めたことや米国経済の先行きに楽観的な見方が強まったことが支援材料となったほか、2017年末にかけて税制改革法成立への期待が急速に高まり、さらに上昇基調を強める展開でした。

米国ハイブリッド優先証券市況は、堅調な相場展開が続きました。2017年８月には、北朝鮮のミサイル発射を受けたリスク回避の動きや金利上昇を背景に軟調に推移する局面もありましたが、相対的に高い利回りを追求する投資家からの需要を反映した良好な需給環境などが下支え要因となり、底堅い相場展開が続きました。

・欧州

欧州株式市況は上昇しました。期首から2017年５月中旬にかけては、英国のＥＵ（欧州連合）強硬離脱への懸念などから一時的に調整する局面も見られましたが、欧州企業の決算内容が総じて良好であったことや中国の貿易統計が強い内容であったこと、フランス大統領選挙をめぐる政治リスクが和らいだことなどを受けて上昇しました。５月中旬から８月にかけては、ドラギＥＣＢ総裁の発言を受けた長期金利の上昇やユーロ高の進行、ドイツ自動車会社によるカルテル疑惑、北朝鮮情勢の緊迫化、スペインでのテロ事件などを背景に下落しました。期末にかけては、ユーロ高の進行などを受けて調整する局面も見られましたが、原油価格の上昇や良好な経済指標の発表、米国税制改革への進展期待などが支援材料となり、上昇しました。

・アジア・オセアニア

アジア・オセアニア株式市況は上昇しました。北朝鮮情勢への警戒感やトランプ政権に対する不透明感などから上値が重くなる局面もありましたが、韓国新大統領による景気刺激策に対する期待、中国インターネット企業の好業績や中国国有企業改革の進展期待、米国の早期追加利上げ懸念の後退や税制改革の進展への期待、コモディティ市況の回復などが支援材料となり、アジア・オセアニア株式市況は上昇しました。

■国内株式市況

国内株式市況は、期首より、米国大統領選挙後の株価上昇に対する警戒感に加えて、トランプ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年内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年内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や米国税制改革法案の議会審議の進展および同法の成立が好感され、株価は上昇しました。

■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。期首より、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月からは、米国の2017年内追加利上げ観測の高まりなどを背景に円安が進み、その後はおおむねレンジ内での推移となりました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

・外国債券インデックスマザーファンド　…純資産総額の25％
・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）…純資産総額の25％
・ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド　…純資産総額の15％
・ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド　…純資産総額の15％
・ダイワ北米好配当株マザーファンド
・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド　…３ファンド合計で純資産総額の10％（＊）
・ダイワ好配当日本株マザーファンド　…純資産総額の10％

＊海外株式の３ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

■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（ＦＴＳＥ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。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

ベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ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、ファンドの資金流出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、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

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

■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

個別銘柄ごとの流動性を勘案しつつ国内リートに幅広く分散投資を行ない、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。配当利回りなどで見た個別銘柄ごとのバリュエーション格差がやや広がっていますが、現状では各社ごとの業績動向や経営戦略といった部分を重視してポートフォリオを構築しており、当面はこのスタンスを維持する方針です。

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、Ｃ＆Ｓに運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。普通株式については、今後もキャッシュフローおよび配当の成長が期待できる業種や銘柄に重点を置いたポートフォリオを継続します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッド（以下、パイオニア社）に運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強固で、安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

オーストラリアや韓国、台湾、香港を中心に市場分散に配慮したポートフォリオとする方針です。革新的な製品・サービスの提供や高い技術力などを背景として、市場予想を上回る業績が期待できる企業を選別して投資を行ないます。また、高い成長性などを背景に今後株式市場での認知度の高まりが見込まれる中小型株に注目しています。

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

国内株式市場は、短期的にはこれまでの上昇に対する反動から調整局面となる可能性がありますが、中期的には、米国景気の加速期待や円高懸念の後退、国内企業の来年度の業績改善への期待、日銀によるＥＴＦ（上場投資信託証券）購入などで、堅調な推移が続くと想定しています。米国新政権によるインフラ（社会基盤）投資拡大や減税などへの期待は中期的な株価押し上げ要因になると思われますが、具体的な政策に関しては不透明な点も多いため、今後慎重に見極めていきたいと考えています。

業種配分については、為替や金利、資源価格などの変動を注視しながら機動的な対応を行なってまいります。また、個別銘柄については、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性などを総合的に判断しながら銘柄を選定して投資する方針です。

ポートフォリオについて　(2017.1.11～2018.1.10)

■当ファンド

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

・外国債券インデックスマザーファンド　…純資産総額の25％
・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）…純資産総額の25％
・ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド　…純資産総額の15％
・ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド　…純資産総額の15％
・ダイワ北米好配当株マザーファンド
・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド　…３ファンド合計で純資産総額の10％（＊）
・ダイワ好配当日本株マザーファンド　…純資産総額の10％

＊海外株式の３ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分しました。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行ないました。期を通じて、公社債組入比率を99％前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、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、ファンドの資金流出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。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、Ｃ＆Ｓに運用の指図にかかる権限を委託しております。当ファンドでは、信託財産の中長期的な成長をめざし保有不動産の価値などと比べて魅力的であると考える銘柄に着目するとともに、安定的な配当利回りの確保をめざしてポートフォリオを構築しました。国・地域別配分では大きなリスクを取らず各地域にバランスよく投資を行ないました。米国では、好調な労働市場から恩恵を受けるとみられる住宅セクターなどに注目しました。欧州では、域内主要都市のオフィスを保有するリートやスペインのホテルを保有するリートに、アジア・オセアニアでは、シドニーの良好なオフィス需給から恩恵を受けるオーストラリアのオフィスリートや香港の商業施設リートなどに注目しました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

リートの組入比率につきましては、通常の状態で信託財産の純資産総額の80％程度以上に維持することを基本としており、おおむね95～98％台程度で推移させました。銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資しました。個別銘柄では、期を通じてみると森ヒルズリート、ケネディクス・オフィス、大江戸温泉リートなどを東証ＲＥＩＴ指数と比較してオーバーウエートとし、ユナイテッド・アーバン、日本リテールファンド、日本プライムリアルティ等をアンダーウエートとしました。

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、Ｃ＆Ｓに運用の指図にかかる権限を委託しております。有価証券の組入比率は、株式を65～75％程度、ハイブリッド優先証券等を20～30％程度としました。銘柄選択にあたって、Ｃ＆Ｓでは、長期的なビジネスモデルが確立した銘柄に絞って調査しております。当ファンドでは、その中から魅力的な配当利回りを将来にわたって提供できるキャッシュフローを生み出せると考える銘柄を中心にポートフォリオを構築しました。その結果、業種別では、ＩＴ（情報技術）セクターや金融セクターを高位で組み入れました。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、パイオニア社に運用の指図にかかる権限を委託しております。株式組入比率は高位に維持しました。銘柄選定にあたって、パイオニア社では、収益基盤が強固で安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資しました。セクター別では金融セクターやヘルスケアセクター、個別銘柄ではNESTLE（スイス、生活必需品）、NOVARTIS（スイス、ヘルスケア）、HSBC HOLDINGS（英国、金融）などを高位で組み入れました。

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

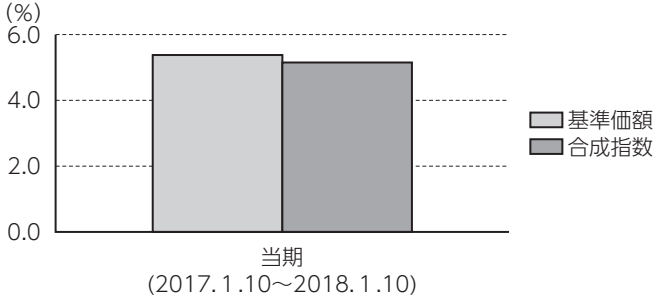
オーストラリアや中国（香港）、台湾、韓国を中心に、高い利益成長が見込まれた銘柄や予想配当利回りが高いと判断された銘柄などを組み入れました。国別では、雇用や住宅市場の底堅い推移から堅調な株価動向が見込まれたオーストラリアや、インターネット銘柄を中心に堅調な業績が見込まれた中国（香港）を組入高位としました。個別銘柄では、半導体の売上高の増加が見込まれた台湾や韓国の半導体関連企業を組入高位としました。

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

株式組入比率（株式先物、Ｊリートを含む。）は、期を通して90％程度以上で推移させました。業種構成は、化学、卸売業、機械、非鉄金属などの比率を引き上げる一方、情報・通信業、不動産業、鉄鋼業、建設業などの比率を引き下げました。個別銘柄では、業績見通しや株価指標などを総合的に勘案して、住友金属鉱山、昭和電工、大和ハウスなどを買い付けました。一方で、日本電信電話、ＮＴＴドコモ、あおぞら銀行などの一部を売却しました。

ベンチマークとの差異について

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



分配金について

当期は、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 ～2018年１月10日
当期分配金（税込み）		(円)	―
	対基準価額比率	(%)	―
	当期の収益	(円)	―
	当期の収益以外	(円)	―
翌期繰越分配可能額		(円)	7,014

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

・外国債券インデックスマザーファンド　…純資産総額の25%
・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）…純資産総額の25%
・ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド　…純資産総額の15%
・ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド　…純資産総額の15%
・ダイワ北米好配当株マザーファンド
・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド　…３ファンド合計で純資産総額の10%（＊）
・ダイワ好配当日本株マザーファンド　…純資産総額の10%

＊海外株式の３ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行なってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッドへの感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流出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、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

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

■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

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

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、Ｃ＆Ｓに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行なってまいります。普通株式については、今後も長期的なビジネスモデルが確立した銘柄の中から、配当利回り、バリュエーション、キャッシュフローおよび配当の成長などを考慮しながら、ポートフォリオを構築します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、パイオニア社に運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強固で、安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

オーストラリアや中国（香港）、台湾、韓国を中心に市場分散に配慮したポートフォリオとする方針です。革新的な製品・サービスの提供や高い技術力などを背景として、市場予想を上回る業績が期待できる企業を選別して投資を行ないます。また、高い成長性などを背景に今後株式市場での認知度の高まりが見込まれる中小型株に注目しています。個別企業の業績動向や株価位置やバリュエーションなどに配慮しつつ、銘柄の入れ替えを行なう方針です。

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

国内株式市場は、国内外の景気や企業業績の堅調さに変化はないこと、日銀のＥＴＦ購入が株価の下支え要因として期待できることなどから、地政学的な懸念の高まりなどがなければ、大幅調整のリスクは小さいと考えています。短期的には米国税制改革法案の可決による好材料出尽くし感などから、一進一退の展開となる可能性はありますが、中期的な上昇期待に変化はないとみています。業種配分については、為替や金利、資源価格などの変動を注視しながら機動的な対応を行なってまいります。また、個別銘柄については、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性などを総合的に判断しながら銘柄を選定して投資する方針です。

１万口当りの費用の明細

項　　目	当期 (2017.1.11～2018.1.10)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	153円	0.972%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 **期中の平均基準価額は15,691円です。**
（投　信　会　社）	(76)	(0.486)	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、目論見書・運用報告書の作成等の対価
（販　売　会　社）	(68)	(0.432)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受　託　銀　行）	(8)	(0.054)	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	9	0.055	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 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）	(5)	(0.032)	
（先　　物）	(0)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.001)	
（投資信託証券）	(3)	(0.022)	
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 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株　　式）	(0)	(0.002)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(1)	(0.007)	
そ　の　他　費　用	4	0.023	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）	(4)	(0.023)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監　査　費　用）	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(△1)	(△0.007)	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	166	1.060	

（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2018年１月10日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	41,518	114,209	16,482	45,200
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	112,527	142,567	20,499	25,980
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	25,870	55,840	25,122	53,469
ダイワ好配当日本株マザーファンド	14,809	39,813	23,144	63,586
ダイワ北米好配当株マザーファンド	12,954	30,932	16,108	38,344
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	8,988	14,568	8,721	13,975
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	1,513	3,269	1,978	4,216
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	55,391	127,524	20,787	48,658

（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2018年１月10日まで）

項目	当期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	58,368,105千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	28,319,362千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	2.06
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,975,835千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,512,552千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.30
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	289,324千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,263,313千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.22
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	4,671,648千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	900,979千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	5.18

（注１）(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。
（注２）単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況
(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) 外国債券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

当期中における利害関係人との取引はありません。

(3) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）における期中の利害関係人との取引状況
（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B／A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D／C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	4,061	216	5.3	3,791	216	5.7
コール・ローン	23,153	－	－	－	－	－

（注）平均保有割合4.6%
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(4) ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドにおける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。

(5) ダイワ好配当日本株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2018年１月10日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B／A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D／C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	19,000	4,883	25.7	39,367	7,299	18.5
株式先物取引	2,705	－	－	1,783	－	－
投資信託証券	－	－	－	413	－	－
コール・ローン	338,209	－	－	－	－	－

（注）平均保有割合0.9%

(6) ダイワ北米好配当株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。

(7) ダイワ欧州好配当株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。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおける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。

(9) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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2018年１月10日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D／C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	30,248	5,342	17.7	9,779	945	9.7
コール・ローン	442,405	－	－	－	－	－

（注）平均保有割合0.5％

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

種類	当期		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド		
	買付額	売付額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
投資信託証券	154	587	1,490

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

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

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

種類	当期
	買付額
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
	百万円
株式	123
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド
	百万円
投資信託証券	2,999

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

(12) 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

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

項目	当期
売買委託手数料総額（A）	1,585千円
うち利害関係人への支払額（B）	215千円
（B）／（A）	13.6%

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

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

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	251,857	276,894	780,426
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(ＢＰＩ)	527,591	619,619	784,190
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	205,071	205,819	468,630
ダイワ好配当日本株マザーファンド	109,446	101,111	332,748
ダイワ北米好配当株マザーファンド	86,532	83,379	220,213
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	47,313	47,580	83,042
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	7,057	6,592	15,656
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	168,586	203,190	477,741

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年１月10日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
外国債券インデックスマザーファンド	780,426	24.3
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(ＢＰＩ)	784,190	24.5
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	468,630	14.6
ダイワ好配当日本株マザーファンド	332,748	10.4
ダイワ北米好配当株マザーファンド	220,213	6.9
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	83,042	2.6
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	15,656	0.5
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	477,741	14.9
コール・ローン等、その他	43,508	1.3
投資信託財産総額	3,206,159	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、１月10日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝112.45円、１カナダ・ドル＝90.17円、１オーストラリア・ドル＝87.88円、１香港ドル＝14.38円、１シンガポール・ドル＝84.16円、１台湾ドル＝3.81円、１イギリス・ポンド＝152.16円、１スイス・フラン＝114.30円、１デンマーク・クローネ＝18.02円、１ノルウェー・クローネ＝13.86円、１スウェーデン・クローネ＝13.65円、１メキシコ・ペソ＝5.84円、100韓国ウォン＝10.51円、１マレーシア・リンギット＝28.02円、１南アフリカ・ランド＝9.11円、１ポーランド・ズロチ＝32.03円、１ユーロ＝134.19円です。
（注３）外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（167,087,570千円）の投資信託財産総額（168,126,878千円）に対する比率は、99.4％です。
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（112,072,346千円）の投資信託財産総額（113,889,380千円）に対する比率は、98.4％です。
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（2,168,932千円）の投資信託財産総額（2,228,645千円）に対する比率は、97.3％です。
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,344,065千円）の投資信託財産総額（1,361,175千円）に対する比率は、98.7％です。
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（945,674千円）の投資信託財産総額（954,568千円）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

2018年１月10日現在

項目	当期末
(A) 資産	**3,206,159,000円**
コール・ローン等	43,508,359
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	780,426,756
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(ＢＰＩ)(評価額)	784,190,350
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド(評価額)	468,630,387
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	332,748,789
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	220,213,483
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	83,042,782
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド(評価額)	15,656,828
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド(評価額)	477,741,266
(B) 負債	**15,333,333**
未払解約金	627,312
未払信託報酬	14,584,577
その他未払費用	121,444
(C) 純資産総額(A－B)	**3,190,825,667**
元本	1,945,585,227
次期繰越損益金	1,245,240,440
(D) 受益権総口数	**1,945,585,227口**
１万口当り基準価額(C／D)	**16,400円**

＊期首における元本額は1,777,104,491円、当期中における追加設定元本額は458,208,043円、同解約元本額は289,727,307円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は16,400円です。

■損益の状況

当期　自2017年１月11日　至2018年１月10日

項目	当期
(A) 配当等収益	**△ 17,573円**
受取利息	1,407
支払利息	△ 18,980
(B) 有価証券売買損益	**180,345,174**
売買益	201,881,398
売買損	△ 21,536,224
(C) 信託報酬等	**△ 28,105,061**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**152,222,540**
(E) 前期繰越損益金	**466,062,211**
(F) 追加信託差損益金	**626,955,689**
(配当等相当額)	(746,426,943)
(売買損益相当額)	(△ 119,471,254)
(G) 合計(D＋E＋F)	**1,245,240,440**
次期繰越損益金(G)	**1,245,240,440**
追加信託差損益金	626,955,689
(配当等相当額)	(746,426,943)
(売買損益相当額)	(△ 119,471,254)
分配準備積立金	618,302,324
繰越損益金	△ 17,573

（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。
（注４）投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：3,414,059円（未監査）

■収益分配金の計算過程（総額）

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	152,232,091
(c) 収益調整金	746,426,943
(d) 分配準備積立金	466,070,233
(e) 当期分配可能額(a＋b＋c＋d)	1,364,729,267
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e－f)	1,364,729,267
(h) 受益権総口数	1,945,585,227口

ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）

最近５期の運用実績

決算期	基準価額		合成指数		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
8期末(2014年1月10日)	13,193	0	29.4	13,280	29.4	29.1	0.3	34.6	－	32.8	1,919
9期末(2015年1月13日)	15,976	0	21.1	16,057	20.9	27.5	0.3	35.0	－	34.1	2,724
10期末(2016年1月12日)	15,254	0	△ 4.5	15,416	△ 4.0	26.6	－	36.5	－	32.9	2,855
11期末(2017年1月10日)	16,276	0	6.7	16,872	9.4	28.9	－	34.7	－	32.9	3,346
12期末(2018年1月10日)	17,554	0	7.9	18,170	7.7	29.4	0.8	34.4	－	31.9	3,894

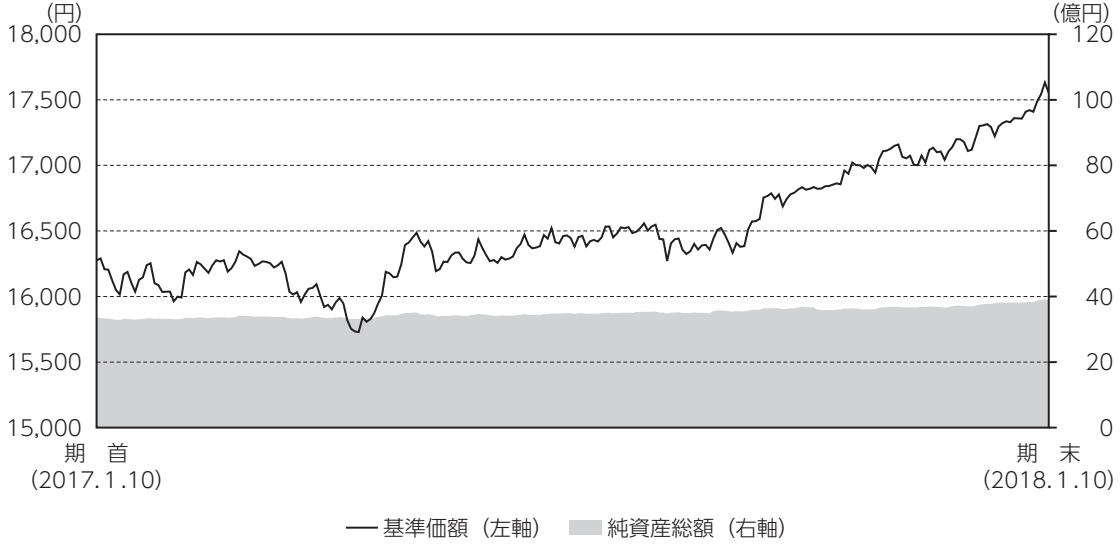
（注１）合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

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

（注２）組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
（注３）株式先物比率は買建比率－売建比率です。
（注４）公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

運用経過

基準価額等の推移について



■基準価額・騰落率

期　首：16,276円
期　末：17,554円
騰落率：7.9%

■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
外国債券インデックスマザーファンド	4.6%	16.2%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	△0.0%	16.3%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	10.4%	16.3%
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	△4.0%	16.5%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	16.2%	11.5%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	16.7%	4.3%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	22.2%	0.8%
ダイワ好配当日本株マザーファンド	29.6%	17.3%

■基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、内外の株式や海外リ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。

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）

年　　月　　日	基準価額		合成指数		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率					
	円	%		%	%	%	%	%	%
(期首)2017年１月10日	16,276	－	16,872	－	28.9	－	34.7	－	32.9
１月末	16,101	△1.1	16,630	△1.4	29.2	0.1	34.9	－	32.5
２月末	16,217	△0.4	16,783	△0.5	29.0	0.1	35.1	－	32.6
３月末	16,094	△1.1	16,644	△1.3	28.7	－	35.1	－	32.2
４月末	16,147	△0.8	16,720	△0.9	29.3	－	35.0	－	32.0
５月末	16,255	△0.1	16,864	△0.0	28.7	－	35.0	－	32.4
６月末	16,414	0.8	17,058	1.1	28.9	－	35.2	－	32.2
７月末	16,484	1.3	17,126	1.5	29.0	0.2	34.9	－	32.6
８月末	16,507	1.4	17,106	1.4	27.7	0.3	35.0	－	32.1
９月末	16,792	3.2	17,412	3.2	29.2	0.4	34.8	－	32.0
10月末	16,944	4.1	17,591	4.3	28.9	0.8	35.0	－	32.2
11月末	17,140	5.3	17,803	5.5	28.7	0.4	34.9	－	32.4
12月末	17,409	7.0	18,047	7.0	29.3	0.4	34.8	－	32.1
(期末)2018年１月10日	17,554	7.9	18,170	7.7	29.4	0.8	34.4	－	31.9

（注）騰落率は期首比。

投資環境について (2017.1.11～2018.1.10)

４～６ページをご参照ください。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の16.7%
・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）…純資産総額の16.7%
・ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド …純資産総額の16.7%
・ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド …純資産総額の16.7%
・ダイワ北米好配当株マザーファンド
・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
…３ファンド合計で純資産総額の16.7%（＊）
・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の16.7%

＊海外株式の３ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

■外国債券インデックスマザーファンド
■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）
■ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド
■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド
■ダイワ北米好配当株マザーファンド
■ダイワ欧州好配当株マザーファンド
■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
■ダイワ好配当日本株マザーファンド
７～８ページをご参照ください。

ポートフォリオについて　(2017.1.11～2018.1.10)

■当ファンド

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

・外国債券インデックスマザーファンド　…純資産総額の16.7%
・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）…純資産総額の16.7%
・ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド　…純資産総額の16.7%
・ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド　…純資産総額の16.7%
・ダイワ北米好配当株マザーファンド
・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド　…３ファンド合計で純資産総額の16.7%（＊）
・ダイワ好配当日本株マザーファンド　…純資産総額の16.7%

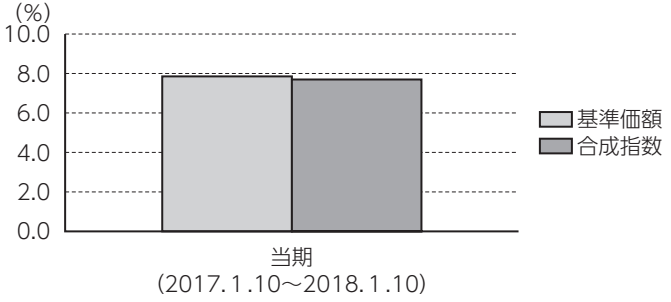
＊海外株式の３ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分しました。

■外国債券インデックスマザーファンド
■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）
■ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド
■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド
■ダイワ北米好配当株マザーファンド
■ダイワ欧州好配当株マザーファンド
■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
■ダイワ好配当日本株マザーファンド

９～10ページをご参照ください。

ベンチマークとの差異について

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



分配金について

当期は、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 ～2018年１月10日
当期分配金（税込み）	(円)	―
対基準価額比率	(%)	―
当期の収益	(円)	―
当期の収益以外	(円)	―
翌期繰越分配可能額	(円)	8,399

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

・外国債券インデックスマザーファンド　…純資産総額の16.7%
・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）…純資産総額の16.7%
・ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド　…純資産総額の16.7%
・ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド　…純資産総額の16.7%
・ダイワ北米好配当株マザーファンド
・ダイワ欧州好配当株マザーファンド　…３ファンド合計で純資産総額の16.7%（＊）
・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
・ダイワ好配当日本株マザーファンド　…純資産総額の16.7%

＊海外株式の３ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

■外国債券インデックスマザーファンド
■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）
■ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド
■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド
■ダイワ北米好配当株マザーファンド
■ダイワ欧州好配当株マザーファンド
■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
■ダイワ好配当日本株マザーファンド

11～12ページをご参照ください。

１万口当りの費用の明細

項　　目	当期 (2017.1.11～2018.1.10)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	187円	1.134%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 **期中の平均基準価額は16,513円です。**
（投　信　会　社）	(95)	(0.572)	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、目論見書・運用報告書の作成等の対価
（販　売　会　社）	(84)	(0.508)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受　託　銀　行）	(9)	(0.054)	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	13	0.080	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 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）	(9)	(0.053)	
（先　　物）	(0)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.002)	
（投資信託証券）	(4)	(0.025)	
有価証券取引税	2	0.012	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 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)	(0.004)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(1)	(0.007)	
そ　の　他　費　用	5	0.029	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）	(5)	(0.029)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監　査　費　用）	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(△1)	(△0.008)	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	207	1.254	

（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2018年１月10日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	37,156	101,631	16,060	44,015
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	99,712	126,282	24,762	31,365
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	37,378	80,303	32,155	68,701
ダイワ好配当日本株マザーファンド	31,652	84,324	45,433	125,212
ダイワ北米好配当株マザーファンド	29,039	69,529	31,890	76,684
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	21,260	34,105	19,122	30,952
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	3,065	6,589	3,883	8,294
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	72,272	167,030	25,606	59,550

（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2018年１月10日まで）

項目	当期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
（ａ）期中の株式売買金額	58,368,105千円
（ｂ）期中の平均組入株式時価総額	28,319,362千円
（ｃ）売買高比率（ａ）／（ｂ）	2.06
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
（ａ）期中の株式売買金額	1,975,835千円
（ｂ）期中の平均組入株式時価総額	1,512,552千円
（ｃ）売買高比率（ａ）／（ｂ）	1.30
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
（ａ）期中の株式売買金額	289,324千円
（ｂ）期中の平均組入株式時価総額	1,263,313千円
（ｃ）売買高比率（ａ）／（ｂ）	0.22
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
（ａ）期中の株式売買金額	4,671,648千円
（ｂ）期中の平均組入株式時価総額	900,979千円
（ｃ）売買高比率（ａ）／（ｂ）	5.18

（注１）（ｂ）は各月末現在の組入株式時価総額の平均。
（注２）単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(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) 外国債券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

当期中における利害関係人との取引はありません。

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

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等Ａ	うち利害関係人との取引状況Ｂ	Ｂ／Ａ	売付額等Ｃ	うち利害関係人との取引状況Ｄ	Ｄ／Ｃ
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	4,061	216	5.3	3,791	216	5.7
コール・ローン	23,153	－	－	－	－	－

（注）平均保有割合3.8%
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(4) ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドにおける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。

(5) ダイワ好配当日本株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2018年１月10日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等Ａ	うち利害関係人との取引状況Ｂ	Ｂ／Ａ	売付額等Ｃ	うち利害関係人との取引状況Ｄ	Ｄ／Ｃ
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	19,000	4,883	25.7	39,367	7,299	18.5
株式先物取引	2,705	－	－	1,783	－	－
投資信託証券	－	－	－	413	－	－
コール・ローン	338,209	－	－	－	－	－

（注）平均保有割合1.9%

(6) ダイワ北米好配当株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。

(7) ダイワ欧州好配当株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。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおける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。

(9) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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2018年１月10日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D／C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	30,248	5,342	17.7	9,779	945	9.7
コール・ローン	442,405	－	－	－	－	－

（注）平均保有割合0.7％

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

種類	当期		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド		
	買付額	売付額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
投資信託証券	154	587	1,490

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

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

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

種類	当期
	買付額
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
	百万円
株式	123
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド
	百万円
投資信託証券	2,999

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

(12) 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

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

項目	当期
売買委託手数料総額（A）	2,809千円
うち利害関係人への支払額（B）	409千円
（B）／（A）	14.6%

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

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

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	202,858	223,954	631,214
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(ＢＰＩ)	426,075	501,025	634,098
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	272,946	278,170	633,366
ダイワ好配当日本株マザーファンド	218,577	204,795	673,962
ダイワ北米好配当株マザーファンド	171,931	169,080	446,559
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	93,929	96,067	167,666
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	14,127	13,310	31,609
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	226,591	273,256	642,481

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年１月10日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
外国債券インデックスマザーファンド	631,214	16.1
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(ＢＰＩ)	634,098	16.2
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	633,366	16.2
ダイワ好配当日本株マザーファンド	673,962	17.2
ダイワ北米好配当株マザーファンド	446,559	11.4
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	167,666	4.3
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	31,609	0.8
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	642,481	16.4
コール・ローン等、その他	55,046	1.4
投資信託財産総額	3,916,005	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＝112.45円、１カナダ・ドル＝90.17円、１オーストラリア・ドル＝87.88円、１香港ドル＝14.38円、１シンガポール・ドル＝84.16円、１台湾ドル＝3.81円、１イギリス・ポンド＝152.16円、１スイス・フラン＝114.30円、１デンマーク・クローネ＝18.02円、１ノルウェー・クローネ＝13.86円、１スウェーデン・クローネ＝13.65円、１メキシコ・ペソ＝5.84円、100韓国ウォン＝10.51円、１マレーシア・リンギット＝28.02円、１南アフリカ・ランド＝9.11円、１ポーランド・ズロチ＝32.03円、１ユーロ＝134.19円です。
（注３）外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（167,087,570千円）の投資信託財産総額（168,126,878千円）に対する比率は、99.4％です。
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（112,072,346千円）の投資信託財産総額（113,889,380千円）に対する比率は、98.4％です。
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（2,168,932千円）の投資信託財産総額（2,228,645千円）に対する比率は、97.3％です。
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,344,065千円）の投資信託財産総額（1,361,175千円）に対する比率は、98.7％です。
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（945,674千円）の投資信託財産総額（954,568千円）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

2018年１月10日現在

項　　目	当　期　末
(A) 資産	**3,916,005,307円**
コール・ローン等	55,046,728
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	631,214,368
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(ＢＰＩ)(評価額)	634,098,174
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド(評価額)	633,366,511
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	673,962,517
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	446,559,623
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	167,666,611
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド(評価額)	31,609,058
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド(評価額)	642,481,717
(B) 負債	**21,400,213**
未払解約金	487,029
未払信託報酬	20,764,956
その他未払費用	148,228
(C) 純資産総額(A－B)	**3,894,605,094**
元本	2,218,600,901
次期繰越損益金	1,676,004,193
(D) 受益権総口数	**2,218,600,901口**
１万口当り基準価額(C／D)	**17,554円**

＊期首における元本額は2,056,311,949円、当期中における追加設定元本額は577,484,738円、同解約元本額は415,195,786円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は17,554円です。

■損益の状況

当期　自2017年１月11日　至2018年１月10日

項　　目	当　　期
(A) 配当等収益	**△　22,113円**
受取利息	2,259
支払利息	△　24,372
(B) 有価証券売買損益	**305,472,903**
売買益	340,359,848
売買損	△　34,886,945
(C) 信託報酬等	**△　40,107,586**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**265,343,204**
(E) 前期繰越損益金	**546,932,096**
(F) 追加信託差損益金	**863,728,893**
(配当等相当額)	(　1,051,239,777)
(売買損益相当額)	(△　187,510,884)
(G) 合計(D＋E＋F)	**1,676,004,193**
次期繰越損益金(G)	**1,676,004,193**
追加信託差損益金	863,728,893
(配当等相当額)	(　1,051,239,777)
(売買損益相当額)	(△　187,510,884)
分配準備積立金	812,297,413
繰越損益金	△　22,113

（注１）信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
（注２）追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
（注３）収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。
（注４）投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：5,562,040円（未監査）

■収益分配金の計算過程（総額）

項　　目	当　　期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	265,355,609
(c) 収益調整金	1,051,239,777
(d) 分配準備積立金	546,941,804
(e) 当期分配可能額(a＋b＋c＋d)	1,863,537,190
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e－f)	1,863,537,190
(h) 受益権総口数	2,218,600,901口

ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

最近５期の運用実績

決算期	基準価額			合成指数		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
8期末(2014年1月10日)	13,144	0	37.2	12,990	37.0	43.6	0.5	13.0	－	39.6	1,528
9期末(2015年1月13日)	16,365	0	24.5	16,043	23.5	41.3	0.4	13.5	－	41.2	2,263
10期末(2016年1月12日)	15,507	0	△ 5.2	15,343	△ 4.4	40.4	－	14.5	－	40.3	2,808
11期末(2017年1月10日)	16,937	0	9.2	17,287	12.7	43.3	－	13.4	－	39.2	3,374
12期末(2018年1月10日)	18,809	0	11.1	19,164	10.9	43.8	1.2	13.0	－	38.1	4,081

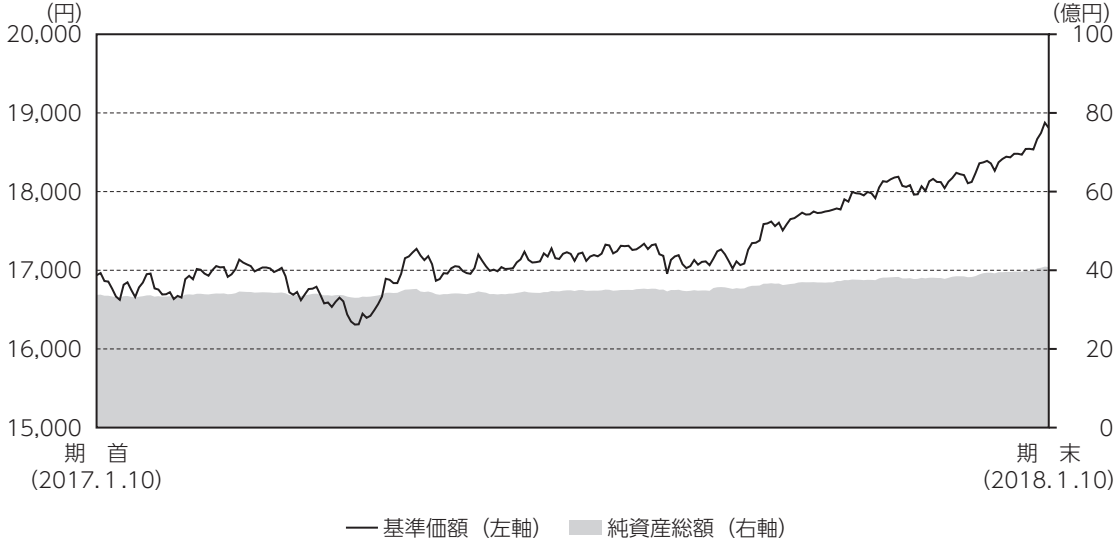
（注１）合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

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

（注２）組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
（注３）株式先物比率は買建比率－売建比率です。
（注４）公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

運用経過

基準価額等の推移について



■基準価額・騰落率

期　首：16,937円
期　末：18,809円
騰落率：11.1%

■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	4.6%	4.8%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	△0.0%	4.8%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	10.4%	19.3%
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	△4.0%	19.7%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	16.2%	17.1%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	16.7%	6.4%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	22.2%	1.2%
ダイワ好配当日本株マザーファンド	29.6%	25.8%

■基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、内外の株式や海外リ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。

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

年　　月　　日	基準価額		合成指数		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率					
	円	%		%	%	%	%	%	%
(期首)2017年１月10日	16,937	－	17,287	－	43.3	－	13.4	－	39.2
１月末	16,770	△ 1.0	17,035	△ 1.5	43.7	0.1	13.3	－	39.0
２月末	16,948	0.1	17,259	△ 0.2	43.4	0.1	13.6	－	39.2
３月末	16,791	△ 0.9	17,103	△ 1.1	43.1	－	13.5	－	38.6
４月末	16,837	△ 0.6	17,172	△ 0.7	43.6	－	13.6	－	38.5
５月末	16,955	0.1	17,347	0.4	43.1	－	13.5	－	38.9
６月末	17,154	1.3	17,572	1.7	43.4	－	13.5	－	38.7
７月末	17,258	1.9	17,668	2.2	43.3	0.4	13.3	－	39.2
８月末	17,240	1.8	17,605	1.8	41.5	0.4	13.4	－	38.5
９月末	17,663	4.3	18,039	4.3	43.6	0.6	13.3	－	38.4
10月末	17,917	5.8	18,330	6.0	43.4	1.1	13.3	－	38.5
11月末	18,172	7.3	18,610	7.7	42.9	0.6	13.2	－	39.0
12月末	18,535	9.4	18,923	9.5	43.9	0.6	13.2	－	38.6
(期末)2018年１月10日	18,809	11.1	19,164	10.9	43.8	1.2	13.0	－	38.1

（注）騰落率は期首比。

投資環境について (2017.1.11～2018.1.10)

４～６ページをご参照ください。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の５％
・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）…純資産総額の５％
・ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド …純資産総額の20％
・ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド …純資産総額の20％
・ダイワ北米好配当株マザーファンド
・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
…３ファンド合計で純資産総額の25％（＊）
・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の25％

＊海外株式の３ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

■外国債券インデックスマザーファンド
■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）
■ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド
■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド
■ダイワ北米好配当株マザーファンド
■ダイワ欧州好配当株マザーファンド
■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
■ダイワ好配当日本株マザーファンド
７～８ページをご参照ください。

ポートフォリオについて (2017.1.11～2018.1.10)

■当ファンド

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

・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の５％
・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）…純資産総額の５％
・ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド …純資産総額の20％
・ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド …純資産総額の20％
・ダイワ北米好配当株マザーファンド
・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド …３ファンド合計で純資産総額の25％（＊）
・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の25％

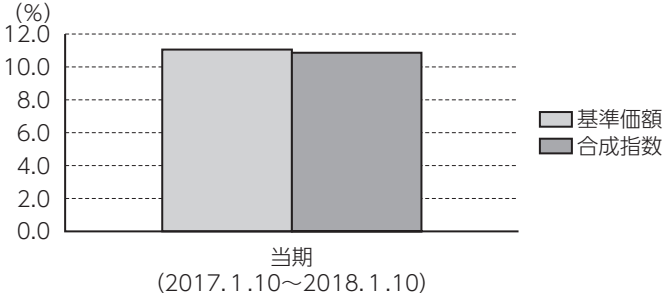
＊海外株式の３ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分しました。

■外国債券インデックスマザーファンド
■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）
■ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド
■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド
■ダイワ北米好配当株マザーファンド
■ダイワ欧州好配当株マザーファンド
■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
■ダイワ好配当日本株マザーファンド

９～10ページをご参照ください。

ベンチマークとの差異について

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



分配金について

当期は、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 ～2018年１月10日
当期分配金（税込み）	(円)	―
対基準価額比率	(%)	―
当期の収益	(円)	―
当期の収益以外	(円)	―
翌期繰越分配可能額	(円)	10,075

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

・外国債券インデックスマザーファンド　…純資産総額の５％
・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）…純資産総額の５％
・ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド　…純資産総額の20％
・ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド　…純資産総額の20％
・ダイワ北米好配当株マザーファンド
・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド　…３ファンド合計で純資産総額の25％（＊）
・ダイワ好配当日本株マザーファンド　…純資産総額の25％

＊海外株式の３ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

■外国債券インデックスマザーファンド
■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）
■ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド
■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド
■ダイワ北米好配当株マザーファンド
■ダイワ欧州好配当株マザーファンド
■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
■ダイワ好配当日本株マザーファンド

11～12ページをご参照ください。

１万口当りの費用の明細

項　　目	当期 (2017.1.11～2018.1.10)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	224円	1.296%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 **期中の平均基準価額は17,316円です。**
（投　信　会　社）	(114)	(0.659)	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、目論見書・運用報告書の作成等の対価
（販　売　会　社）	(101)	(0.583)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受　託　銀　行）	(9)	(0.054)	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	20	0.113	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 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）	(14)	(0.080)	
（先　　物）	(0)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(1)	(0.003)	
（投資信託証券）	(5)	(0.030)	
有価証券取引税	3	0.015	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 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)	(0.006)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(2)	(0.009)	
そ　の　他　費　用	6	0.036	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)	(0.037)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監　査　費　用）	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(△2)	(△0.009)	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	253	1.459	

（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2018年１月10日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	12,710	34,913	3,841	10,435
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	34,599	43,804	6,031	7,637
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	49,289	106,185	28,831	61,187
ダイワ好配当日本株マザーファンド	36,938	99,891	47,254	129,386
ダイワ北米好配当株マザーファンド	36,001	86,316	32,663	77,140
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	28,543	46,184	19,986	32,099
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	4,734	10,224	5,303	11,277
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	89,564	206,973	19,135	44,502

（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2018年１月10日まで）

項目	当期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
（ａ）期中の株式売買金額	58,368,105千円
（ｂ）期中の平均組入株式時価総額	28,319,362千円
（ｃ）売買高比率（ａ）／（ｂ）	2.06
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
（ａ）期中の株式売買金額	1,975,835千円
（ｂ）期中の平均組入株式時価総額	1,512,552千円
（ｃ）売買高比率（ａ）／（ｂ）	1.30
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
（ａ）期中の株式売買金額	289,324千円
（ｂ）期中の平均組入株式時価総額	1,263,313千円
（ｃ）売買高比率（ａ）／（ｂ）	0.22
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
（ａ）期中の株式売買金額	4,671,648千円
（ｂ）期中の平均組入株式時価総額	900,979千円
（ｃ）売買高比率（ａ）／（ｂ）	5.18

（注１）（ｂ）は各月末現在の組入株式時価総額の平均。
（注２）単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況
(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) 外国債券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

当期中における利害関係人との取引はありません。

(3) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）における期中の利害関係人との取引状況
（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等Ａ	うち利害関係人との取引状況Ｂ	Ｂ／Ａ	売付額等Ｃ	うち利害関係人との取引状況Ｄ	Ｄ／Ｃ
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	4,061	216	5.3	3,791	216	5.7
コール・ローン	23,153	－	－	－	－	－

（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。

(4) ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・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。

(5) ダイワ好配当日本株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2018年１月10日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等Ａ	うち利害関係人との取引状況Ｂ	Ｂ／Ａ	売付額等Ｃ	うち利害関係人との取引状況Ｄ	Ｄ／Ｃ
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	19,000	4,883	25.7	39,367	7,299	18.5
株式先物取引	2,705	－	－	1,783	－	－
投資信託証券	－	－	－	413	－	－
コール・ローン	338,209	－	－	－	－	－

（注）平均保有割合2.9％

(6) ダイワ北米好配当株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。

(7) ダイワ欧州好配当株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。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおける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。

(9) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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2018年１月10日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D／C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	30,248	5,342	17.7	9,779	945	9.7
コール・ローン	442,405	－	－	－	－	－

（注）平均保有割合0.8％

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

種類	当期		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド		
	買付額	売付額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
投資信託証券	154	587	1,490

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

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

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

種類	当期
	買付額
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
	百万円
株式	123
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド
	百万円
投資信託証券	2,999

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

(12) 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

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

項目	当期
売買委託手数料総額（A）	4,003千円
うち利害関係人への支払額（B）	606千円
（B）／（A）	15.1％

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

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

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	60,951	69,820	196,787
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(ＢＰＩ)	127,663	156,231	197,726
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	326,332	346,790	789,607
ダイワ好配当日本株マザーファンド	330,274	319,959	1,052,955
ダイワ北米好配当株マザーファンド	260,216	263,554	696,074
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	141,291	149,848	261,531
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	21,346	20,777	49,343
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	270,748	341,178	802,178

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年１月10日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
外国債券インデックスマザーファンド	196,787	4.8
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(ＢＰＩ)	197,726	4.8
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	789,607	19.2
ダイワ好配当日本株マザーファンド	1,052,955	25.6
ダイワ北米好配当株マザーファンド	696,074	16.9
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	261,531	6.4
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	49,343	1.2
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	802,178	19.5
コール・ローン等、その他	61,567	1.6
投資信託財産総額	4,107,772	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＝112.45円、１カナダ・ドル＝90.17円、１オーストラリア・ドル＝87.88円、１香港ドル＝14.38円、１シンガポール・ドル＝84.16円、１台湾ドル＝3.81円、１イギリス・ポンド＝152.16円、１スイス・フラン＝114.30円、１デンマーク・クローネ＝18.02円、１ノルウェー・クローネ＝13.86円、１スウェーデン・クローネ＝13.65円、１メキシコ・ペソ＝5.84円、100韓国ウォン＝10.51円、１マレーシア・リンギット＝28.02円、１南アフリカ・ランド＝9.11円、１ポーランド・ズロチ＝32.03円、１ユーロ＝134.19円です。
（注３）外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（167,087,570千円）の投資信託財産総額（168,126,878千円）に対する比率は、99.4％です。
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（112,072,346千円）の投資信託財産総額（113,889,380千円）に対する比率は、98.4％です。
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（2,168,932千円）の投資信託財産総額（2,228,645千円）に対する比率は、97.3％です。
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,344,065千円）の投資信託財産総額（1,361,175千円）に対する比率は、98.7％です。
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（945,674千円）の投資信託財産総額（954,568千円）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

2018年１月10日現在

項目	当期末
(A) 資産	**4,107,772,333円**
コール・ローン等	61,567,734
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	196,787,996
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(ＢＰＩ)(評価額)	197,726,076
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド(評価額)	789,607,897
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	1,052,955,008
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	696,074,447
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	261,531,265
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド(評価額)	49,343,318
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド(評価額)	802,178,592
(B) 負債	**26,007,509**
未払解約金	1,675,840
未払信託報酬	24,180,635
その他未払費用	151,034
(C) 純資産総額(A－B)	**4,081,764,824**
元本	2,170,099,737
次期繰越損益金	1,911,665,087
(D) 受益権総口数	**2,170,099,737口**
１万口当り基準価額(C／D)	**18,809円**

＊期首における元本額は1,992,388,997円、当期中における追加設定元本額は541,348,837円、同解約元本額は363,638,097円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は18,809円です。

■損益の状況

当期　自2017年１月11日　至2018年１月10日

項目	当期
(A) 配当等収益	**△ 23,350円**
受取利息	1,946
支払利息	△ 25,296
(B) 有価証券売買損益	**426,298,546**
売買益	465,737,461
売買損	△ 39,438,915
(C) 信託報酬等	**△ 46,326,737**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**379,948,459**
(E) 前期繰越損益金	**570,905,265**
(F) 追加信託差損益金	**960,811,363**
(配当等相当額)	(1,235,688,485)
(売買損益相当額)	(△ 274,877,122)
(G) 合計(D＋E＋F)	**1,911,665,087**
次期繰越損益金(G)	**1,911,665,087**
追加信託差損益金	960,811,363
(配当等相当額)	(1,235,688,485)
(売買損益相当額)	(△ 274,877,122)
分配準備積立金	950,877,074
繰越損益金	△ 23,350

（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。
（注４）投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：7,582,933円（未監査）

■収益分配金の計算過程（総額）

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	379,961,669
(c) 収益調整金	1,235,688,485
(d) 分配準備積立金	570,915,405
(e) 当期分配可能額(a＋b＋c＋d)	2,186,565,559
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e－f)	2,186,565,559
(h) 受益権総口数	2,170,099,737口

ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2017年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年１月10日）現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を37～53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2018年１月10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） 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） 2.125% 2024/3/31	556,076	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） 3% 2047/2/15	467,890	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） 1.5% 2020/5/15	448,954	United Kingdom Gilt（イギリス） 1.25% 2018/7/22	410,942
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） 1.25% 2018/10/31	406,508
United States Treasury Note/Bond（アメリカ） 2.25% 2027/2/15	446,563	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% 2019/6/30	440,296	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） 1.75% 2020/11/15	405,018	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% 2022/11/30	401,213	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

下記は、2018年１月10日現在における外国債券インデックスマザーファンド（59,579,655千口）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区分	額面金額	評価額		組入比率	うちＢＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	631,289	632,055	71,074,593	42.3	－	17.9	16.6	7.8
	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ	38,111	40,161	3,621,394	2.2	－	0.9	0.7	0.5
	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	39,364	41,726	3,666,953	2.2	－	1.4	0.6	0.2
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
シンガポール	7,237	7,576	637,666	0.4	－	0.2	0.1	0.1
	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
イギリス	61,984	78,220	11,902,084	7.1	－	5.1	1.6	0.4
	千スイス・フラン	千スイス・フラン						
スイス	2,187	2,582	295,166	0.2	－	0.1	0.1	0.0
	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ						
デンマーク	42,972	53,619	966,225	0.6	－	0.4	0.1	0.1
	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ						
ノルウェー	33,577	35,445	491,268	0.3	－	0.2	0.1	0.1
	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ						
スウェーデン	51,650	58,048	792,358	0.5	－	0.2	0.2	0.1

2018年1月10日現在								
区分	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	%	%	%	%	%
メキシコ	210,035	213,517	1,246,941	0.7	−	0.5	0.2	0.1
	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	27,539	27,675	775,477	0.5	−	0.3	0.1	0.1
	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド						
南アフリカ	113,745	104,688	953,713	0.6	−	0.5	0.1	−
	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ						
ポーランド	32,767	33,567	1,075,161	0.6	−	0.2	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
(アイルランド)	8,727	9,891	1,327,288	0.8	−	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
(オランダ)	23,354	27,346	3,669,571	2.2	−	1.4	0.6	0.2
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
(ベルギー)	26,235	31,761	4,262,068	2.5	−	1.8	0.5	0.2
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
(フランス)	108,602	127,185	17,067,044	10.2	−	6.5	2.6	1.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
(ドイツ)	77,176	89,852	12,057,251	7.2	−	4.2	1.9	1.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
(スペイン)	61,668	72,002	9,662,064	5.8	−	3.8	1.3	0.6
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
(イタリア)	107,340	121,303	16,277,674	9.7	−	5.7	2.9	1.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
(フィンランド)	6,863	7,553	1,013,642	0.6	−	0.4	0.2	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
(オーストリア)	16,867	19,690	2,642,315	1.6	−	1.0	0.4	0.2
ユーロ								
(小計)	436,832	506,587	67,978,921	40.5	−	25.2	10.6	4.6
合計	−	−	165,477,927	98.5	−	53.2	31.3	14.0

(注1) 邦貨換算金額は、2018年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) 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)

2018年1月10日現在							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,161	3,191	358,909	2019/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,096	3,146	353,788	2019/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	2,621	2,690	302,524	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,020	4,124	463,824	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,280	4,424	497,529	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,073	3,178	357,394	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,854	2,896	325,669	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,509	4,578	514,820	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,076	4,261	479,182	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,631	295,956	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,528	284,335	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,137	240,400	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,861	1,852	208,361	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,426	1,417	159,345	2019/01/31

外国債券インデックスマザーファンド

2018年1月10日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,195	359,337	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,843	1,832	206,111	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	300	298	33,575	2019/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	559	554	62,335	2019/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,407	270,754	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,385	2,359	265,342	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,368	1,349	151,805	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,784	1,755	197,405	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,471	277,916	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,872	1,844	207,380	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,215	2,179	245,116	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	884	872	98,166	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,168	3,070	345,287	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,353	1,329	149,476	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,894	1,863	209,542	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,366	1,349	151,775	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,281	481,433	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,968	1,937	217,920	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,160	1,138	127,996	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,544	511,060	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,451	1,422	159,952	2020/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,461	2,424	272,652	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,131	2,123	238,787	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,827	2,824	317,670	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,768	2,787	313,471	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,993	1,997	224,619	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,885	1,882	211,718	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,345	2,325	261,530	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,123	576,123	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,501	2,496	280,731	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,026	2,019	227,119	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,006	2,023	227,512	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,328	599,161	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,185	2,177	244,818	2019/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,647	1,648	185,362	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,373	2,363	265,747	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,734	1,728	194,333	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,383	2,375	267,086	2019/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,821	2,831	318,433	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	5,412	5,433	611,001	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,975	2,964	333,334	2019/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,407	2,415	271,660	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,241	2,228	250,611	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,732	2,718	305,723	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,885	2,873	323,071	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,485	3,481	391,457	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.8750	904	974	109,560	2019/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.1250	724	794	89,316	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.7500	642	750	84,434	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,555	287,402	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	787	88,583	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,075	120,953	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.5000	630	829	93,247	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	930	104,616	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	890	100,167	2028/08/15

2018年1月10日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	925	104,104	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	473	595	66,972	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	964	1,337	150,441	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	991	1,298	146,009	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,626	2,055	231,182	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	547	736	82,808	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	686	77,249	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	661	74,369	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	849	949	106,746	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,387	156,052	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	760	972	109,351	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,524	171,397	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,710	2,226	250,395	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,478	1,865	209,724	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,591	1,875	210,928	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,825	205,247	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,754	2,330	262,079	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,727	194,289	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,367	1,583	178,097	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,522	171,216	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,703	191,545	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,389	156,280	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,731	1,699	191,153	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,630	2,579	290,035	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,026	2,123	238,804	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,998	4,006	450,555	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,064	3,485	391,946	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	3,581	4,161	467,990	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,617	4,121	463,450	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,657	3,999	449,716	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,326	3,310	372,254	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,840	319,429	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,162	5,139	577,924	2024/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,729	3,905	439,210	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,989	2,973	334,405	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,291	145,279	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,404	3,392	381,493	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,614	406,420	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,190	3,164	355,813	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,146	241,327	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,921	3,869	435,127	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,696	3,783	425,486	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,850	320,574	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,325	4,287	482,144	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,156	354,960	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,204	2,189	246,191	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,963	3,905	439,128	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,427	2,357	265,132	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,568	626,122	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,763	3,493	392,898	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,788	2,752	309,491	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,809	1,774	199,496	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,792	2,754	309,787	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,831	318,438	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,651	635,500	2025/05/15

外国債券インデックスマザーファンド

2018年1月10日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,835	3,923	441,250	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,607	2,570	289,008	2020/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,556	287,454	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,780	312,667	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,013	2,977	334,813	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,001	2,972	334,219	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,802	315,188	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,135	3,103	349,005	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,152	242,041	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,548	623,952	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,573	3,569	401,406	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,399	269,870	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,868	2,819	317,062	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,410	271,090	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,876	2,825	317,720	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,735	645,005	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,116	3,058	343,876	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	3,795	426,753	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,508	282,095	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,057	343,765	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,197	696,863	2022/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	3,013	338,869	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,492	2,468	277,619	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,146	2,130	239,609	2019/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,126	3,058	343,936	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,366	5,018	564,324	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,065	2,040	229,422	2019/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,490	280,018	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,428	3,172	356,745	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,100	2,078	233,736	2019/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,309	3,209	360,934	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,262	2,170	244,085	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,920	328,396	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	2,035	228,864	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,905	1,880	211,513	2019/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,029	5,624	632,510	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,390	268,829	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	1,995	224,387	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	3,164	355,866	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,507	2,473	278,134	2019/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,631	295,903	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,407	270,712	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,100	2,069	232,702	2019/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,413	271,414	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,848	320,323	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,456	276,213	2019/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,600	5,156	579,877	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	3,046	342,621	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,453	275,929	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,562	400,591	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,567	401,111	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,617	294,367	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,273	255,603	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,600	2,554	287,218	2019/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,370	266,524	2023/09/30

2018年1月10日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	2,925	328,923	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,147	2,112	237,497	2019/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,500	5,267	592,282	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,895	325,593	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,397	269,570	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,650	3,639	409,317	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,400	1,376	154,741	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,453	275,864	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,400	2,357	265,135	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,440	1,424	160,137	2019/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,982	222,896	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,400	1,392	156,562	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,478	278,707	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,500	1,482	166,704	2020/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,700	1,687	189,715	2019/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,040	3,945	443,717	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,967	333,661	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,457	276,346	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,875	3,961	445,478	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,130	2,103	236,514	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,300	2,280	256,490	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,965	333,502	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,261	254,310	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,900	1,885	211,992	2020/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,850	1,835	206,430	2019/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,250	4,176	469,658	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	900	886	99,631	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	850	840	94,525	2020/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,700	5,622	632,299	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,700	2,759	310,349	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	2,951	331,891	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	2,924	328,889	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	3,954	444,649	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,934	329,968	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,964	445,846	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,948	219,099	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,700	2,667	299,947	2020/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,962	445,526	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,932	329,759	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,336	262,774	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,000	1,974	222,007	2020/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	991	111,496	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,752	646,868	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,300	1,282	144,236	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,848	320,267	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,942	330,866	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,800	2,722	306,150	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,100	2,038	229,225	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	600	593	66,718	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,930	217,131	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	983	110,556	2020/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,451	275,721	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	990	111,355	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,330	374,561	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,000	988	111,171	2020/10/15

外国債券インデックスマザーファンド

2018年1月10日現在

区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,465	277,192	2022/10/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,300	3,215	361,544	2027/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,100	3,016	339,168	2047/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,455	388,560	2024/10/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,600	3,569	401,354	2020/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,800	2,789	313,641	2019/11/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,988	223,660	2020/12/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,132	352,247	2024/11/30
通貨小計	銘柄数	242銘柄						
	金額				631,289	632,055	71,074,593	
					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	425	469	42,379	2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	386	575	51,877	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,327	119,667	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,627	146,795	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,112	1,566	141,247	2037/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,524	1,566	141,231	2019/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	1,747	157,612	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,876	1,949	175,754	2020/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	998	90,002	2021/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,808	163,083	2022/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,561	1,902	171,545	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,218	109,897	2023/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,439	129,796	2024/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	853	854	77,023	2019/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,627	1,626	146,680	2019/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,197	1,287	116,093	2048/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,164	104,996	2025/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,719	1,707	154,010	2020/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,831	1,780	160,519	2020/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,129	1,070	96,537	2026/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,237	1,194	107,686	2021/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,480	1,419	127,993	2021/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,114	100,512	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	840	791	71,363	2022/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,620	1,601	144,383	2019/02/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,100	1,086	97,988	2019/05/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	700	669	60,329	2022/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,360	1,339	120,751	2019/08/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	500	495	44,658	2019/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	587	52,958	2028/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	600	591	53,352	2023/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,600	1,582	142,663	2020/02/01
通貨小計	銘柄数	32銘柄						
	金額				38,111	40,161	3,621,394	
					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	1,455	1,513	132,986	2019/03/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,699	237,237	2021/05/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,409	2,541	223,304	2020/04/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,162	2,484	218,302	2022/07/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,389	210,026	2023/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,040	267,157	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,473	2,515	221,021	2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,314	1,380	121,346	2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,398	2,512	220,775	2025/04/21

2018年1月10日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,358	1,622	142,591	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,848	3,199	281,209	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,011	2,040	179,324	2019/10/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	863	944	83,002	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	557	535	47,029	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,195	2,173	191,029	2020/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	712	719	63,242	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,522	2,545	223,738	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,978	1,902	167,203	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	932	871	76,628	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	1,784	156,859	2021/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,200	2,209	194,175	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	99	8,759	2022/11/21
通貨小計 銘柄数	22銘柄						
通貨小計 金額				39,364	41,726	3,666,953	
				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	3.2500	696	726	61,105	2020/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	863	72,669	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	465	39,151	2022/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.5000	599	607	51,131	2019/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	623	663	55,839	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	359	381	32,116	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	495	504	42,492	2021/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	416	35,010	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	491	513	43,235	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	368	415	34,942	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	125	133	11,251	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	415	415	34,999	2019/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	124	127	10,707	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	224	226	19,055	2020/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	318	331	27,873	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	250	251	21,176	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	190	187	15,753	2021/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	200	16,876	2022/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	150	145	12,276	2036/08/01
通貨小計 銘柄数	19銘柄						
通貨小計 金額				7,237	7,576	637,666	
				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	2,280	2,361	359,400	2020/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,121	2,261	344,170	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,542	386,933	2021/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,582	2,051	312,210	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,502	228,551	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,300	1,283	195,240	2022/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	460	427	65,024	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	200	198	30,152	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	600	615	93,633	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	810	805	122,554	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	500	495	75,335	2023/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,375	209,251	2021/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,396	212,498	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,340	1,799	273,748	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,873	285,087	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,032	2,828	430,360	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,457	2,213	336,846	2038/12/07

外国債券インデックスマザーファンド

2018年1月10日現在

区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,724	1,880	286,066	2020/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,938	447,139	2055/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,086	3,215	489,280	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,571	239,177	2027/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,596	2,448	372,576	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,480	2,044	311,086	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,523	2,438	371,084	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	873	913	138,935	2019/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,246	1,792	272,746	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,568	238,721	2022/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,870	2,633	400,716	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,428	1,504	228,874	2019/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,244	2,135	324,892	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,795	1,945	296,012	2020/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,297	349,568	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,633	1,815	276,239	2021/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,352	2,062	313,846	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,338	355,880	2022/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,066	2,661	405,024	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,942	2,085	317,361	2023/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,621	2,685	408,553	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,251	2,292	348,896	2019/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,842	2,048	311,742	2024/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	2,869	436,659	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	41銘柄						
	金額				61,984	78,220	11,902,084	
					千スイス・フラン	千スイス・フラン		
スイス		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	404	497	56,915	2023/02/11
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	497	706	80,768	2028/04/08
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	517	544	62,267	2019/05/12
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	407	438	50,120	2020/07/06
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	362	394	45,094	2021/04/28
通貨小計	銘柄数	5銘柄						
	金額				2,187	2,582	295,166	
					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	11,512	19,302	347,829	2039/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	8,601	9,331	168,151	2019/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	5,550	6,258	112,778	2021/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,267	94,920	2023/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	8,363	9,334	168,200	2025/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,600	2,596	46,790	2027/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,529	27,555	2020/11/15
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金額				42,972	53,619	966,225	
					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	7,075	7,465	103,467	2019/05/22
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,998	7,663	106,213	2021/05/25
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	5,224	5,452	75,570	2023/05/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,518	62,626	2024/03/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,483	48,287	2025/03/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,352	46,459	2026/02/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,450	3,509	48,644	2027/02/17
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金額				33,577	35,445	491,268	

2018年1月10日現在

区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ	千円	
スウェーデン		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	9,095	10,526	143,692	2020/12/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	8,385	8,883	121,258	2019/03/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	5,698	77,778	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	9,821	134,063	2022/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,578	103,444	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,095	5,888	80,380	2025/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,680	5,905	80,611	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,750	3,745	51,129	2028/05/12
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金額				51,650	58,048	792,358	
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.0000	21,447	20,471	119,555	2019/12/11
		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	13,290	11,892	69,452	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	4,000	4,133	24,139	2047/11/07
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	10,633	10,905	63,690	2023/12/07
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	22,119	25,173	147,011	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	14,668	14,682	85,745	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,874	8,474	49,492	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	8,844	9,488	55,410	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	9,694	10,527	61,482	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	18,928	19,119	111,659	2020/06/11
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	27,826	27,017	157,783	2021/06/10
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	13,182	76,987	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	13,099	12,623	73,722	2022/06/09
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	18,654	18,801	109,803	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	6,944	7,021	41,007	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額				210,035	213,517	1,246,941	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7340	647	671	18,826	2019/07/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	573	541	15,164	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.2480	738	794	22,260	2028/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	1,603	1,638	45,920	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,195	33,485	2030/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,916	1,960	54,923	2021/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,551	43,467	2026/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,284	36,005	2031/06/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	867	24,307	2022/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	718	20,131	2027/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1270	618	600	16,820	2032/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,044	1,048	29,374	2020/03/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	989	27,724	2023/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	477	449	12,590	2033/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	586	562	15,759	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8890	656	665	18,639	2020/07/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	612	17,156	2043/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,078	30,224	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	857	870	24,397	2021/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6540	648	654	18,329	2019/10/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	737	737	20,671	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	700	708	19,841	2020/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,167	32,723	2022/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	820	791	22,172	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7590	768	774	21,691	2019/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	702	703	19,703	2023/08/17

外国債券インデックスマザーファンド

2018年1月10日現在

区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	913	25,602	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	641	17,987	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	354	9,926	2021/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	500	506	14,204	2022/03/10
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750	760	21,296	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	350	350	9,821	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	500	511	14,323	2037/04/07
通貨小計	銘柄数	33銘柄						
	金額				27,539	27,675	775,477	
					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	7.2500	5,768	5,775	52,614	2020/01/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	16,434	18,392	167,559	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	7,612	5,505	50,152	2036/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	4,622	4,521	41,186	2021/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	8,904	6,327	57,642	2041/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	8,999	7,531	68,616	2031/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	5,539	5,523	50,318	2023/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	13,452	12,188	111,034	2048/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	11,021	9,974	90,869	2037/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	8,862	8,166	74,400	2030/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	7,944	7,205	65,637	2044/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	8,243	7,594	69,189	2032/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	4,166	3,940	35,894	2035/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	2,179	2,041	18,597	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金額				113,745	104,688	953,713	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	2,309	2,643	84,673	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	5.5000	1,912	2,040	65,356	2019/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.5000	2,478	2,462	78,862	2020/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,377	3,203	102,621	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,127	2,118	67,841	2021/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.7500	3,051	3,007	96,316	2021/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,370	2,215	70,976	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,320	2,306	73,871	2022/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	−	400	392	12,574	2019/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,300	1,295	41,493	2023/01/25
		Poland Government Bond	国債証券	−	300	286	9,178	2020/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,026	32,892	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.2500	2,256	2,459	78,777	2020/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,084	1,223	39,178	2021/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,225	2,377	76,166	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,840	1,889	60,507	2019/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,591	2,618	83,871	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	17銘柄						
	金額				32,767	33,567	1,075,161	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（アイルランド）		IRISH TREASURY	国債証券	4.4000	684	732	98,309	2019/06/18
		IRISH TREASURY	国債証券	5.9000	570	635	85,218	2019/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,131	1,526	204,839	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	765	881	118,327	2020/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	504	603	81,023	2023/03/20
		IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	723	97,146	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	761	873	117,158	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	535	71,876	2022/03/15

2018年1月10日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	681	711	95,529	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,104	148,155	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	350	358	48,128	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	−	50	49	6,700	2022/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	4.5000	1,035	1,154	154,875	2020/04/18
国小計 銘柄数	13銘柄						
国小計 金額				8,727	9,891	1,327,288	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オランダ）	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	757	101,645	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,239	1,836	246,389	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,355	2,052	275,390	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	945	126,856	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,347	1,442	193,531	2019/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,146	1,263	169,495	2020/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,349	2,077	278,772	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,463	1,651	221,586	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,598	214,544	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,429	191,799	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,521	204,185	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	924	941	126,379	2019/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,084	1,461	196,075	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,698	227,906	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,374	1,397	187,564	2020/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,291	1,289	172,991	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,338	1,349	181,047	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	−	1,200	1,212	162,697	2022/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,200	1,222	164,000	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	−	200	199	26,709	2024/01/15
国小計 銘柄数	20銘柄						
国小計 金額				23,354	27,346	3,669,571	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ベルギー）	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,443	193,729	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	924	918	123,209	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	558	605	81,235	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,283	1,334	179,129	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	744	721	96,879	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	190	198	26,653	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	150	151	20,274	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,000	1,011	135,670	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	650	660	88,675	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	260	283	38,027	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	300	303	40,729	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,524	338,712	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,720	365,126	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	1,377	1,625	218,076	2022/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	821	866	116,266	2019/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	1,736	1,933	259,501	2020/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,674	2,593	347,996	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,692	227,095	2021/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,333	178,992	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,589	213,304	2022/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	680	948	127,243	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	1,123	1,191	159,839	2019/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,503	201,804	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	753	1,109	148,866	2045/06/22

外国債券インデックスマザーファンド

2018年1月10日現在

区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,740	233,531	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	597	756	101,496	2034/06/22
国小計	銘柄数	26銘柄						
	金額				26,235	31,761	4,262,068	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フランス）		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	653	759	101,966	2019/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	985	1,429	191,885	2023/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,225	3,202	429,771	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,623	3,947	529,674	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,807	4,593	616,343	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,709	4,192	562,584	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,075	3,266	438,366	2019/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,364	2,148	288,373	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,230	3,667	492,159	2021/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,824	4,150	556,904	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,697	4,595	616,667	2023/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,734	4,345	583,148	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,263	3,517	472,019	2019/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,380	3,689	495,158	2020/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,167	1,884	252,878	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,938	528,533	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,113	3,367	451,945	2020/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,550	4,026	540,251	2021/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,630	4,127	553,907	2022/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,499	4,182	561,206	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	2,996	402,155	2022/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,238	3,007	403,575	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,661	491,271	2023/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,086	3,496	469,178	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,264	2,312	310,298	2019/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,787	3,283	440,549	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,399	3,748	502,986	2024/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,322	2,367	317,727	2019/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,792	2,829	379,705	2025/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	－	3,070	3,103	416,515	2020/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,101	2,198	295,045	2025/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,193	2,233	299,678	2020/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,420	3,603	483,500	2031/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	－	1,592	1,602	214,980	2019/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,737	2,742	367,979	2026/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,609	1,574	211,230	2036/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	587	553	74,238	2066/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	－	2,170	2,192	294,217	2021/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,334	313,305	2026/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	－	2,000	2,012	270,025	2022/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	620	650	87,332	2039/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	－	700	707	94,904	2020/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,577	345,935	2027/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,365	183,218	2048/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	－	500	499	67,048	2023/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	500	496	66,689	2028/05/25
国小計	銘柄数	46銘柄						
	金額				108,602	127,185	17,067,044	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ドイツ）		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,339	179,787	2024/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,567	2,451	328,900	2027/07/04

2018年1月10日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,045	274,526	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,250	1,785	239,648	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,569	210,551	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,310	310,077	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	2,826	379,253	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,071	3,148	422,477	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	1,974	265,009	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,399	2,422	325,065	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	2,682	2,799	375,704	2019/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,481	2,635	353,699	2019/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,075	2,236	300,071	2020/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,928	2,099	281,780	2020/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,474	2,130	285,839	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,444	1,551	208,254	2020/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,543	341,288	2021/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,890	253,629	2021/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,552	208,363	2021/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,807	3,070	412,063	2022/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,425	325,458	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,728	2,223	298,399	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,778	238,592	2022/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,529	205,296	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,974	264,974	2023/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,785	239,627	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,728	231,936	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,959	2,542	341,202	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,743	233,896	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,637	219,760	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,251	302,170	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,266	304,107	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,168	2,213	296,980	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	−	2,850	2,774	372,322	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,580	212,114	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,300	1,304	175,094	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	400	394	52,925	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	−	1,000	1,008	135,272	2019/03/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	−	400	403	54,201	2019/06/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	−	100	101	13,567	2019/09/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	−	1,000	1,012	135,802	2019/12/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,438	1,465	196,618	2019/02/22
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,113	1,129	151,568	2019/04/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,151	1,169	156,900	2019/10/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	−	1,731	1,754	235,388	2020/04/17
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,448	1,479	198,539	2020/10/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	−	1,578	1,601	214,896	2021/04/09
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	−	1,400	1,419	190,531	2021/10/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	−	360	364	48,913	2022/04/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	−	400	403	54,197	2022/10/07
国小計 銘柄数	50銘柄						
国小計 金額				77,176	89,852	12,057,251	
				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	2,804	376,343	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,745	1,829	245,494	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,552	1,570	210,705	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,792	1,935	259,722	2025/10/31

外国債券インデックスマザーファンド

2018年1月10日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1500	1,250	1,292	173,500	2020/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,835	246,355	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,672	1,683	225,949	2019/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,747	1,793	240,703	2021/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,052	1,078	144,757	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	850	922	123,825	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,730	1,734	232,705	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	580	585	78,599	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,816	243,778	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	550	563	75,659	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,800	1,790	240,295	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	300	301	40,409	2021/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	300	302	40,532	2022/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	2,924	392,378	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,654	2,136	286,633	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,608	2,270	304,654	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	2,101	281,951	2024/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6000	2,382	2,567	344,479	2019/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3000	1,775	1,924	258,221	2019/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,373	1,899	254,933	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,101	2,306	309,494	2020/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	1,789	2,268	304,353	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,681	1,916	257,237	2020/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,515	2,974	399,170	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,710	363,780	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,438	327,182	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,608	3,265	438,162	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,601	1,953	262,154	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,270	1,709	229,404	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,499	2,197	294,903	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,836	1,911	256,557	2019/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,350	315,356	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,368	317,856	2024/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	1,966	263,859	2020/01/31
国小計 銘柄数	38銘柄						
国小計 金額				61,668	72,002	9,662,064	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（イタリア）	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,598	214,502	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,599	214,590	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,345	448,967	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,942	260,667	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0500	1,445	1,478	198,333	2019/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,429	1,446	194,137	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,680	225,520	2022/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,680	225,504	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,765	1,590	213,449	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,511	1,536	206,193	2020/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,591	1,629	218,703	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,554	208,645	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	774	786	105,484	2020/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,440	1,301	174,629	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,359	2,369	317,937	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,286	1,267	170,107	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	812	816	109,558	2019/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,674	1,685	226,224	2021/06/01

2018年1月10日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	924	849	113,985	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,568	1,491	200,167	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	700	684	91,829	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,357	182,096	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	648	553	74,267	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	858	861	115,623	2019/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	700	683	91,698	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	2,010	2,047	274,727	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	310	41,694	2024/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	350	359	48,206	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	970	977	131,235	2020/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	600	616	82,768	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,000	1,002	134,549	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	700	706	94,869	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	700	701	94,185	2024/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	100	100	13,454	2020/10/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,454	3,205	430,104	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,003	537,241	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,655	2,299	308,550	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,074	2,175	291,897	2019/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,921	2,103	282,280	2020/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,498	3,267	438,463	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,790	3,261	437,706	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	3,064	411,256	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,734	2,275	305,397	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,714	364,253	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,708	2,857	383,398	2019/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,531	2,717	364,611	2019/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,625	352,272	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,043	2,665	357,727	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,560	2,798	375,587	2020/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,214	2,444	328,054	2020/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,509	336,780	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,382	319,678	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,644	354,877	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,381	319,536	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	2,021	271,314	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,910	2,338	313,776	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,810	2,252	302,283	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,245	301,304	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,613	2,058	276,207	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,621	351,817	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,729	1,928	258,730	2021/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.5000	1,100	1,140	153,049	2019/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,537	340,502	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,938	2,166	290,734	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,698	227,967	2021/12/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	1.5000	1,246	1,280	171,788	2019/08/01
国小計 銘柄数	66銘柄						
国小計 金額				107,340	121,303	16,277,674	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フィンランド）	Finland Government Bond	国債証券	0.3750	432	441	59,237	2020/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	405	54,461	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	290	38,979	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	411	413	55,532	2026/04/15

外国債券インデックスマザーファンド

2018年1月10日現在

区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Finland Government Bond	国債証券	−	200	199	26,739	2023/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	−	270	271	36,492	2022/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	296	39,808	2027/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	4.3750	416	446	59,956	2019/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	848	113,924	2025/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	3.3750	632	687	92,233	2020/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	3.5000	459	516	69,337	2021/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	471	63,283	2028/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	1.6250	612	662	88,886	2022/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	481	64,589	2023/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	529	70,988	2042/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	590	79,191	2024/04/15
国小計	銘柄数	16銘柄						
	金額				6,863	7,553	1,013,642	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オーストリア）		Austria Government Bond	国債証券	0.2500	527	534	71,736	2019/10/18
		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	930	124,896	2025/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	926	945	126,878	2026/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	734	728	97,715	2047/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	150	128	17,261	2086/11/02
		Austria Government Bond	国債証券	−	300	299	40,170	2023/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	580	574	77,111	2027/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	170	177	23,753	2117/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	−	400	402	54,043	2022/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,265	169,850	2027/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.9000	1,248	1,385	185,951	2020/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,527	204,919	2021/09/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,073	1,621	217,572	2037/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.3500	989	1,046	140,429	2019/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,195	160,482	2026/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	928	124,659	2022/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	1,021	137,121	2022/11/22
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	318	528	70,905	2062/01/26
		Austria Government Bond	国債証券	1.9500	738	764	102,639	2019/06/18
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	861	115,666	2044/06/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,054	141,474	2023/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	621	742	99,652	2034/05/23
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,024	137,424	2024/10/21
国小計	銘柄数	23銘柄						
	金額				16,867	19,690	2,642,315	
通貨小計	銘柄数	298銘柄						
	金額				436,832	506,587	67,978,921	
合計	銘柄数	760銘柄						
	金額						165,477,927	

（注1）邦貨換算金額は、2018年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
（注2）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の決算日（2017年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年１月10日）現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の組入資産の内容等を54～57ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の主要な売買銘柄

公　社　債

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

買		付	売		付
銘	柄	金　額	銘	柄	金　額
		千円			千円
346	10年国債 0.1% 2027/3/20	190,146	368	2年国債 0.1% 2018/9/15	173,561
348	10年国債 0.1% 2027/9/20	150,764	116	5年国債 0.2% 2018/12/20	163,634
133	5年国債 0.1% 2022/9/20	131,294	127	5年国債 0.1% 2021/3/20	160,588
347	10年国債 0.1% 2027/6/20	130,864	365	2年国債 0.1% 2018/6/15	140,406
373	2年国債 0.1% 2019/2/15	126,000	344	10年国債 0.1% 2026/9/20	132,564
345	10年国債 0.1% 2026/12/20	125,426	124	5年国債 0.1% 2020/6/20	125,975
322	10年国債 0.9% 2022/3/20	115,766	371	2年国債 0.1% 2018/12/15	125,385
32	東日本旅客鉄道 2.26% 2024/3/19	115,239	362	2年国債 0.1% 2018/3/15	124,494
130	5年国債 0.1% 2021/12/20	107,210	333	10年国債 0.6% 2024/3/20	104,863
25－6	大阪市公債 0.694% 2023/11/22	104,348	332	10年国債 0.6% 2023/12/20	104,623

（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、2018年１月10日現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）（12,192,600千口）の内容です。

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

2018年１月10日現在							
区　分	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	11,128,000	12,248,930	79.4	－	55.0	19.1	5.2
地方債証券	1,100,000	1,126,771	7.3	－	3.3	2.0	2.0
特殊債券(除く金融債券)	800,000	818,682	5.3	－	2.0	2.7	0.7
金融債券	100,000	99,854	0.6	－	－	0.6	－
普通社債券	1,000,000	1,022,211	6.6	－	1.4	2.0	3.3
合　計	14,128,000	15,316,450	99.3	－	61.7	26.4	11.1

（注１）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注２）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。
（注３）評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

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

2018年１月10日現在

区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	373　2年国債	0.1000	125,000	125,321	2019/02/15
	300　10年国債	1.5000	8,000	8,154	2019/03/20
	41　20年国債	1.5000	40,000	40,775	2019/03/20
	42　20年国債	2.6000	22,000	22,711	2019/03/20
	375　2年国債	0.1000	100,000	100,295	2019/04/15
	376　2年国債	0.1000	20,000	20,062	2019/05/15
	377　2年国債	0.1000	25,000	25,083	2019/06/15
	119　5年国債	0.1000	41,000	41,129	2019/06/20
	301　10年国債	1.5000	35,000	35,815	2019/06/20
	302　10年国債	1.4000	54,000	55,179	2019/06/20
	380　2年国債	0.1000	60,000	60,236	2019/09/15
	120　5年国債	0.2000	10,000	10,054	2019/09/20
	121　5年国債	0.1000	55,000	55,204	2019/09/20
	43　20年国債	2.9000	14,000	14,714	2019/09/20
	122　5年国債	0.1000	83,000	83,346	2019/12/20
	305　10年国債	1.3000	100,000	102,746	2019/12/20
	123　5年国債	0.1000	100,000	100,459	2020/03/20
	306　10年国債	1.4000	10,000	10,330	2020/03/20
	44　20年国債	2.5000	32,000	33,827	2020/03/20
	45　20年国債	2.4000	20,000	21,098	2020/03/20
	124　5年国債	0.1000	35,000	35,170	2020/06/20
	308　10年国債	1.3000	100,000	103,430	2020/06/20
	309　10年国債	1.1000	103,000	106,030	2020/06/20
	46　20年国債	2.2000	19,000	20,074	2020/06/22
	125　5年国債	0.1000	150,000	150,787	2020/09/20
	310　10年国債	1.0000	30,000	30,889	2020/09/20
	311　10年国債	0.8000	42,000	43,018	2020/09/20
	47　20年国債	2.2000	23,000	24,433	2020/09/21
	126　5年国債	0.1000	164,000	164,941	2020/12/20
	312　10年国債	1.2000	94,000	97,599	2020/12/20
	48　20年国債	2.5000	9,000	9,692	2020/12/21
	313　10年国債	1.3000	34,000	35,514	2021/03/20
	314　10年国債	1.1000	77,000	79,937	2021/03/20
	49　20年国債	2.1000	4,000	4,282	2021/03/22
	50　20年国債	1.9000	30,000	31,929	2021/03/22
	128　5年国債	0.1000	137,000	137,872	2021/06/20
	315　10年国債	1.2000	90,000	94,032	2021/06/20
	316　10年国債	1.1000	56,000	58,316	2021/06/20
	51　20年国債	2.0000	25,000	26,811	2021/06/21
	129　5年国債	0.1000	110,000	110,731	2021/09/20
	317　10年国債	1.1000	40,000	41,768	2021/09/20
	318　10年国債	1.0000	33,000	34,337	2021/09/20
	52　20年国債	2.1000	19,000	20,540	2021/09/21
	130　5年国債	0.1000	127,000	127,901	2021/12/20
	319　10年国債	1.1000	140,000	146,581	2021/12/20
	320　10年国債	1.0000	35,000	36,507	2021/12/20
	53　20年国債	2.1000	13,000	14,122	2021/12/20
	54　20年国債	2.2000	14,000	15,263	2021/12/20
	131　5年国債	0.1000	60,000	60,453	2022/03/20
	321　10年国債	1.0000	65,000	67,975	2022/03/20
	322　10年国債	0.9000	140,000	145,819	2022/03/20

2018年１月10日現在

区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
	55　20年国債	2.0000	41,000	44,591	2022/03/21
	132　5年国債	0.1000	90,000	90,740	2022/06/20
	323　10年国債	0.9000	70,000	73,069	2022/06/20
	324　10年国債	0.8000	80,000	83,152	2022/06/20
	56　20年国債	2.0000	12,000	13,110	2022/06/20
	57　20年国債	1.9000	24,000	26,115	2022/06/20
	133　5年国債	0.1000	130,000	131,131	2022/09/20
	325　10年国債	0.8000	160,000	166,624	2022/09/20
	58　20年国債	1.9000	35,000	38,260	2022/09/20
	134　5年国債	0.1000	20,000	20,178	2022/12/20
	326　10年国債	0.7000	20,000	20,773	2022/12/20
	59　20年国債	1.7000	3,000	3,264	2022/12/20
	328　10年国債	0.6000	60,000	62,107	2023/03/20
	61　20年国債	1.0000	40,000	42,226	2023/03/20
	329　10年国債	0.8000	50,000	52,359	2023/06/20
	62　20年国債	0.8000	16,000	16,754	2023/06/20
	63　20年国債	1.8000	30,000	33,051	2023/06/20
	330　10年国債	0.8000	81,000	84,951	2023/09/20
	331　10年国債	0.6000	73,000	75,728	2023/09/20
	64　20年国債	1.9000	35,000	38,903	2023/09/20
	332　10年国債	0.6000	35,000	36,354	2023/12/20
	65　20年国債	1.9000	42,000	46,862	2023/12/20
	66　20年国債	1.8000	30,000	33,294	2023/12/20
	333　10年国債	0.6000	53,000	55,119	2024/03/20
	67　20年国債	1.9000	19,000	21,284	2024/03/20
	68　20年国債	2.2000	25,000	28,471	2024/03/20
	69　20年国債	2.1000	12,000	13,591	2024/03/20
	334　10年国債	0.6000	156,000	162,441	2024/06/20
	70　20年国債	2.4000	18,000	20,827	2024/06/20
	71　20年国債	2.2000	17,000	19,450	2024/06/20
	335　10年国債	0.5000	140,000	144,971	2024/09/20
	72　20年国債	2.1000	53,000	60,564	2024/09/20
	336　10年国債	0.5000	18,000	18,656	2024/12/20
	337　10年国債	0.3000	30,000	30,677	2024/12/20
	73　20年国債	2.0000	30,000	34,221	2024/12/20
	74　20年国債	2.1000	22,000	25,248	2024/12/20
	338　10年国債	0.4000	152,000	156,479	2025/03/20
	75　20年国債	2.1000	14,000	16,123	2025/03/20
	76　20年国債	1.9000	25,000	28,432	2025/03/20
	339　10年国債	0.4000	45,000	46,338	2025/06/20
	78　20年国債	1.9000	17,000	19,401	2025/06/20
	79　20年国債	2.0000	14,000	16,081	2025/06/20
	80　20年国債	2.1000	20,000	23,122	2025/06/20
	340　10年国債	0.4000	130,000	133,893	2025/09/20
	81　20年国債	2.0000	65,000	74,935	2025/09/20
	82　20年国債	2.1000	28,000	32,495	2025/09/20
	341　10年国債	0.3000	15,000	15,344	2025/12/20
	342　10年国債	0.1000	40,000	40,261	2026/03/20
	85　20年国債	2.1000	31,000	36,267	2026/03/20
	86　20年国債	2.3000	6,000	7,117	2026/03/20
	87　20年国債	2.2000	20,000	23,562	2026/03/20

2018年1月10日現在

区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
	343 10年国債	0.1000	152,000	152,895	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	33,000	39,303	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	15,000	17,738	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	68,000	68,352	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	37,000	43,900	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	12,000	14,341	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	150,000	150,666	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	45,000	53,207	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	143,000	143,587	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	18,000	21,208	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	45,000	53,433	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	130,000	130,487	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	30,000	36,321	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	23,000	27,415	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	150,000	150,504	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	25,000	30,152	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	34,000	40,680	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	40,000	40,078	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	53,000	63,585	2027/12/20
	100 20年国債	2.2000	35,000	42,452	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	18,000	22,195	2028/03/20
	102 20年国債	2.4000	10,000	12,375	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	21,000	25,771	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	34,000	41,022	2028/06/20
	105 20年国債	2.1000	38,000	45,987	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	16,000	19,532	2028/09/20
	107 20年国債	2.1000	20,000	24,274	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	48,000	57,223	2028/12/20
	109 20年国債	1.9000	35,000	41,828	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	27,000	32,863	2029/03/20
	111 20年国債	2.2000	35,000	43,115	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	29,000	35,397	2029/06/20
	113 20年国債	2.1000	64,000	78,289	2029/09/20
	114 20年国債	2.1000	45,000	55,192	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	22,000	27,240	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	9,000	11,380	2030/02/20
	116 20年国債	2.2000	27,000	33,522	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	37,000	45,496	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	4,000	5,024	2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	13,000	15,868	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	13,000	15,552	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	60,000	70,320	2030/06/20
	121 20年国債	1.9000	56,000	67,779	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	10,000	11,979	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	8,000	10,706	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	42,000	51,997	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	45,000	55,144	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	25,000	31,341	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	21,000	25,789	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	23,000	27,950	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	8,000	10,047	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	32,000	38,939	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	34,000	40,930	2031/06/20

2018年1月10日現在

区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
	130 20年国債	1.8000	28,000	33,743	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	27,000	32,181	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	9,000	11,583	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	25,000	29,841	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	47,000	56,734	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	15,000	18,135	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	20,000	23,890	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	40,000	47,234	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	12,000	15,365	2032/05/20
	137 20年国債	1.7000	18,000	21,546	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	24,000	28,043	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	32,000	37,834	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	60,000	71,867	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	5,000	6,062	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	11,000	12,711	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	48,000	57,565	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	30,000	36,407	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	15,000	16,669	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	48,000	56,896	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	24,000	28,100	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	9,000	10,810	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	65,000	78,078	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	11,000	13,883	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	58,000	69,747	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	11,000	13,729	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	74,000	87,896	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	22,000	28,863	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	59,000	69,126	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	21,000	27,930	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	67,000	78,547	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	26,000	34,649	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	56,000	64,760	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	17,000	22,428	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	84,000	94,434	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	20,000	26,067	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	69,000	77,500	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	15,000	19,581	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	72,000	81,960	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	16,000	21,461	2035/09/20
	154 20年国債	1.2000	67,000	75,109	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	16,000	20,930	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	59,000	64,119	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	17,000	22,857	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	63,000	61,846	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	16,000	21,528	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	77,000	72,671	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	15,000	20,230	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	63,000	62,625	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	17,000	22,332	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	60,000	60,566	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	32,000	42,642	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	54,000	55,357	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	69,000	69,301	2037/06/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

2018年1月10日現在

区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
	27　30年国債	2.5000	32,000	43,315	2037/09/20
	162　20年国債	0.6000	60,000	60,158	2037/09/20
	28　30年国債	2.5000	34,000	46,128	2038/03/20
	29　30年国債	2.4000	43,000	57,721	2038/09/20
	30　30年国債	2.3000	56,000	74,311	2039/03/20
	31　30年国債	2.2000	38,000	49,811	2039/09/20
	32　30年国債	2.3000	49,000	65,436	2040/03/20
	33　30年国債	2.0000	55,000	70,236	2040/09/20
	34　30年国債	2.2000	50,000	66,080	2041/03/20
	35　30年国債	2.0000	56,000	71,739	2041/09/20
	36　30年国債	2.0000	59,000	75,724	2042/03/20
	37　30年国債	1.9000	57,000	72,004	2042/09/20
	38　30年国債	1.8000	39,000	48,443	2043/03/20
	39　30年国債	1.9000	37,000	46,839	2043/06/20
	40　30年国債	1.8000	29,000	36,063	2043/09/20
	41　30年国債	1.7000	29,000	35,404	2043/12/20
	42　30年国債	1.7000	33,000	40,301	2044/03/20
	43　30年国債	1.7000	37,000	45,203	2044/06/20
	44　30年国債	1.7000	42,000	51,329	2044/09/20
	45　30年国債	1.5000	28,000	32,890	2044/12/20
	46　30年国債	1.5000	40,000	46,986	2045/03/20
	47　30年国債	1.6000	44,000	52,749	2045/06/20
	48　30年国債	1.4000	45,000	51,705	2045/09/20
	49　30年国債	1.4000	45,000	51,696	2045/12/20
	50　30年国債	0.8000	44,000	43,949	2046/03/20
	51　30年国債	0.3000	45,000	39,197	2046/06/20
	52　30年国債	0.5000	47,000	43,205	2046/09/20
	53　30年国債	0.6000	40,000	37,721	2046/12/20
	54　30年国債	0.8000	45,000	44,682	2047/03/20
	55　30年国債	0.8000	32,000	31,735	2047/06/20
	56　30年国債	0.8000	50,000	49,524	2047/09/20
	57　30年国債	0.8000	10,000	9,892	2047/12/20
	1　40年国債	2.4000	60,000	84,678	2048/03/20
	2　40年国債	2.2000	23,000	31,349	2049/03/20
	3　40年国債	2.2000	19,000	25,974	2050/03/20
	4　40年国債	2.2000	30,000	41,121	2051/03/20
	5　40年国債	2.0000	35,000	46,088	2052/03/20
	6　40年国債	1.9000	28,000	36,109	2053/03/20
	7　40年国債	1.7000	31,000	38,133	2054/03/20
	8　40年国債	1.4000	23,000	26,130	2055/03/20
	9　40年国債	0.4000	30,000	24,484	2056/03/20
	10　40年国債	0.9000	33,000	31,980	2057/03/20
種別小計 銘柄数	250銘柄				
種別小計 金額			11,128,000	12,248,930	
地方債証券	21－2　埼玉県公債	1.5700	100,000	102,104	2019/05/27
	76　共同発行地方	1.4000	100,000	102,074	2019/07/25
	21－6　大阪市公債	1.5700	100,000	102,845	2019/11/25
	21－35　兵庫県公債	1.4600	100,000	102,832	2020/01/22
	116　共同発行地方	0.8000	100,000	103,469	2022/11/25
	117　共同発行地方	0.7200	100,000	103,114	2022/12/22
	24－16　愛知県公債	0.7570	100,000	103,370	2023/01/31
	25－6　大阪市公債	0.6940	100,000	103,394	2023/11/22
	3　兵庫県公債12年	0.5600	100,000	102,806	2025/04/16

2018年1月10日現在

区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
	751　東京都公債	0.3700	100,000	101,575	2025/12/19
	28－1　静岡県公債	0.0800	100,000	99,184	2026/03/19
種別小計 銘柄数	11銘柄				
種別小計 金額			1,100,000	1,126,771	
特殊債券（除く金融債券）	5　日本政策投資ＣＯ	1.7450	100,000	102,029	2019/03/20
	98　政保道路機構	1.3000	100,000	102,621	2020/01/31
	14　政保地方公共６	0.1990	100,000	100,411	2020/06/18
	122　政保道路機構	0.9000	100,000	102,516	2020/11/30
	36　地方公共団体	0.8920	100,000	103,508	2022/05/27
	190　政保道路機構	0.6050	100,000	103,005	2023/05/31
	65　地方公共団体	0.5350	100,000	102,605	2024/10/28
	261　政保道路機構	0.3810	100,000	101,984	2025/11/28
種別小計 銘柄数	8銘柄				
種別小計 金額			800,000	818,682	
金融債券	い789　利付商工債	0.0500	100,000	99,854	2021/02/26
種別小計 銘柄数	1銘柄				
種別小計 金額			100,000	99,854	
普通社債券	25　東日本高速道	0.2990	100,000	100,303	2019/03/20
	27　東日本高速道	0.2480	100,000	100,260	2019/06/20
	1　明治安田2014基	0.5100	100,000	100,328	2019/08/07
	164　オリックス	1.1460	100,000	101,655	2019/08/07
	62　トヨタファイナンス	0.2030	100,000	100,240	2019/12/20
	70　東日本旅客鉄道	1.1930	100,000	102,996	2020/09/29
	44　野村ホールディング	0.7230	100,000	101,490	2021/02/25
	33　中日本高速道	1.0840	100,000	103,582	2021/09/17
	32　東日本旅客鉄道	2.2600	100,000	112,726	2024/03/19
	20　成田国際空港	0.1050	100,000	98,628	2026/08/21
種別小計 銘柄数	10銘柄				
種別小計 金額			1,000,000	1,022,211	
合計 銘柄数	280銘柄				
合計 金額			14,128,000	15,316,450	

（注）単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド」の決算日（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（2018年１月10日）現在におけるダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの組入資産の内容等を58～59ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの主要な売買銘柄

投資信託証券

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

買			付		売			付	
銘柄	口数	金額	平均単価		銘柄	口数	金額	平均単価	
	千口	千円	円			千口	千円	円	
GOODMAN GROUP（オーストラリア）	5,916.411	3,856,377	651		KLEPIERRE（フランス）	1,870.526	8,277,599	4,425	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA（スペイン）	2,184.264	3,024,622	1,384		VICINITY CENTRES（オーストラリア）	20,807.606	4,983,340	239	
UNIBAIL-RODAMCO SE（フランス）	97.402	2,682,851	27,544		SEGRO PLC（イギリス）	5,609.673	4,228,348	753	
EQUITY RESIDENTIAL（アメリカ）	330.709	2,524,320	7,633		SIMON PROPERTY GROUP INC（アメリカ）	198.847	3,806,526	19,142	
AVALONBAY COMMUNITIES INC（アメリカ）	117.874	2,411,569	20,458		AVALONBAY COMMUNITIES INC（アメリカ）	177.378	3,681,613	20,755	
BOSTON PROPERTIES INC（アメリカ）	135.085	1,949,816	14,433		SCENTRE GROUP（オーストラリア）	9,646.709	3,443,092	356	
HOST HOTELS & RESORTS INC（アメリカ）	872.532	1,914,730	2,194		VENTAS INC（アメリカ）	370.282	2,671,258	7,214	
CROWN CASTLE INTL CORP（アメリカ）	160.972	1,821,298	11,314		SL GREEN REALTY CORP（アメリカ）	224.91	2,625,492	11,673	
FONCIERE DES REGIONS（フランス）	155.876	1,721,776	11,045		BIG YELLOW GROUP PLC（イギリス）	2,139.587	2,415,719	1,129	
HCP INC（アメリカ）	492.903	1,716,251	3,481		EQUITY RESIDENTIAL（アメリカ）	344.18	2,396,325	6,962	

（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、2018年１月10日現在におけるダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド（49,411,771千口）の内容です。

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

ファンド名	2018年１月10日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド				
（アメリカ）	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	204.291	7,664	861,929	0.8
SIMON PROPERTY GROUP INC	147.527	24,420	2,746,045	2.4
BOSTON PROPERTIES INC	135.085	16,939	1,904,864	1.7
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	268.099	11,254	1,265,601	1.1
GGP INC	359.547	8,355	939,617	0.8
EQUITY RESIDENTIAL	322.97	20,137	2,264,425	2.0
EPR PROPERTIES	141.74	8,692	977,518	0.9
EQUINIX INC	17.691	8,066	907,105	0.8
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	288.006	7,237	813,867	0.7
HOST HOTELS & RESORTS INC	661.338	13,517	1,520,070	1.4
GRAMERCY PROPERTY TRUST	351.015	9,431	1,060,602	0.9
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	193.267	6,466	727,181	0.6
RLJ LODGING TRUST	338.62	7,456	838,473	0.7
PHYSICIANS REALTY TRUST	978.661	16,627	1,869,756	1.7
CYRUSONE INC	106.284	6,243	702,039	0.6
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	239.038	6,757	759,892	0.7
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	188.652	6,859	771,338	0.7

ファンド名	2018年１月10日現在			
	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	%
INVITATION HOMES INC	411.57	9,392	1,056,133	0.9
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	445.431	8,685	976,729	0.9
VENTAS INC	53.401	3,080	346,425	0.3
GEO GROUP INC/THE	302.267	7,130	801,822	0.7
CROWN CASTLE INTL CORP	220.457	23,738	2,669,429	2.4
SUN COMMUNITIES INC	215.149	19,535	2,196,770	2.0
PROLOGIS INC	111.219	6,967	783,537	0.7
COUSINS PROPERTIES INC	1,100.283	10,023	1,127,151	1.0
DDR CORP	532.293	4,556	512,370	0.5
DUKE REALTY CORP	339.289	8,899	1,000,754	0.9
ESSEX PROPERTY TRUST INC	56.465	13,340	1,500,193	1.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST	56.752	7,118	800,528	0.7
HCP INC	114.402	2,802	315,180	0.3
KILROY REALTY CORP	204.121	14,721	1,655,399	1.5
MID-AMERICA APARTMENT COMM	113.473	10,781	1,212,331	1.1
REGENCY CENTERS CORP	176.553	11,634	1,308,338	1.2
UDR INC	675.816	24,964	2,807,274	2.5
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	178.769	4,776	537,140	0.5

ファンド名		2018年1月10日現在			
		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	%
CUBESMART		344.454	9,658	1,086,097	1.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC		572.45	9,474	1,065,356	0.9
DIGITAL REALTY TRUST INC		217.576	24,499	2,754,919	2.4
EXTRA SPACE STORAGE INC		114.194	9,490	1,067,225	0.9
EDUCATION REALTY TRUST INC		267.549	9,045	1,017,203	0.9
DOUGLAS EMMETT INC		283.337	11,203	1,259,793	1.1
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額	12,049.101	451,653	50,788,435	
	銘柄数<比率>	41銘柄			<45.1%>
(カナダ)		千口	千カナダ・ドル	千円	%
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		245.49	11,017	993,456	0.9
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		501.527	21,214	1,912,919	1.7
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	747.017	32,232	2,906,375	
	銘柄数<比率>	2銘柄			< 2.6%>
(オーストラリア)		千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
NATIONAL STORAGE REIT		13,294.696	20,407	1,793,398	1.6
SCENTRE GROUP		2,346.553	9,785	859,916	0.8
DEXUS		4,734.579	48,198	4,235,641	3.8
INVESTA OFFICE FUND		4,080.104	18,727	1,645,788	1.5
MIRVAC GROUP		10,367.637	24,156	2,122,881	1.9
GOODMAN GROUP		5,008.951	42,175	3,706,371	3.3
CHARTER HALL GROUP		2,435.532	14,954	1,314,172	1.2
INGENIA COMMUNITIES GROUP		7,578.273	21,143	1,858,080	1.7
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	49,846.325	199,547	17,536,250	
	銘柄数<比率>	8銘柄			<15.6%>
(香港)		千口	千香港ドル	千円	%
FORTUNE REIT		13,833.07	134,872	1,939,465	1.7
LINK REIT		2,834.42	210,455	3,026,352	2.7
香港ドル通貨計	口数、金額	16,667.49	345,328	4,965,818	
	銘柄数<比率>	2銘柄			< 4.4%>
(シンガポール)		千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT		13,343.813	19,348	1,628,372	1.4
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		3,027.6	8,416	708,351	0.6
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		4,182.5	12,380	1,041,917	0.9
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	20,553.913	40,145	3,378,641	
	銘柄数<比率>	3銘柄			< 3.0%>
(イギリス)		千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC		19,193.438	12,245	1,863,262	1.7
SEGRO PLC		3,112.251	18,281	2,781,692	2.5
HAMMERSON PLC		627.843	3,346	509,188	0.5
UNITE GROUP PLC		709.47	5,767	877,657	0.8
BRITISH LAND CO PLC		1,614.9	11,071	1,684,678	1.5
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		656.412	4,493	683,676	0.6
DERWENT LONDON PLC		151.714	4,645	706,856	0.6
WORKSPACE GROUP PLC		296.911	2,998	456,297	0.4
SAFESTORE HOLDINGS PLC		1,127.069	5,475	833,121	0.7
BIG YELLOW GROUP PLC		544.738	4,603	700,397	0.6
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		2,648.042	4,965	755,486	0.7
TRITAX BIG BOX REIT PLC		3,783.955	5,675	863,649	0.8
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	34,466.743	83,569	12,715,965	
	銘柄数<比率>	12銘柄			<11.3%>
ユーロ（ベルギー）		千口	千ユーロ	千円	%
AEDIFICA		34.332	2,725	365,796	0.3
国小計	口数、金額	34.332	2,725	365,796	
	銘柄数<比率>	1銘柄			< 0.3%>

ファンド名		2018年1月10日現在			
		口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ（フランス）		千口	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO SE		97.402	20,610	2,765,691	2.5
GECINA SA		154.277	24,128	3,237,860	2.9
FONCIERE DES REGIONS		155.876	14,535	1,950,510	1.7
国小計	口数、金額	407.555	59,274	7,954,061	
	銘柄数<比率>	3銘柄			< 7.1%>
ユーロ（ドイツ）		千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		934.255	12,276	1,647,331	1.5
国小計	口数、金額	934.255	12,276	1,647,331	
	銘柄数<比率>	1銘柄			< 1.5%>
ユーロ（スペイン）		千口	千ユーロ	千円	%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		94.4	816	109,510	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI		253.338	4,157	557,864	0.5
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		3,064.758	35,306	4,737,713	4.2
国小計	口数、金額	3,412.496	40,279	5,405,089	
	銘柄数<比率>	3銘柄			< 4.8%>
ユーロ通貨計	口数、金額	4,788.638	114,556	15,372,279	
	銘柄数<比率>	8銘柄			<13.7%>
合計	口数、金額	139,119.227	－	107,663,766	
	銘柄数<比率>	76銘柄			<95.7%>

(注1) 邦貨換算金額は、2018年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) 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。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の決算日（2017年11月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年１月10日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの組入資産の内容等を60ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの主要な売買銘柄

投資信託証券

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

買				売			
	付				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
ジャパンリアルエステイト	5.082	2,842,230	559,274	日本ビルファンド	3.877	2,169,633	559,616
日本ビルファンド	4.32	2,514,653	582,095	日本ロジスティクスファンド投資法人	7	1,578,284	225,469
野村不動産マスターＦ	12.922	1,861,619	144,065	グローバル・ワン不動産投資法人	2.495	947,740	379,855
産業ファンド	2.5	1,255,706	502,282	ジャパンリアルエステイト	1.31	699,285	533,805
福岡リート投資法人	6.42	1,150,662	179,230	大和証券オフィス投資法人	1.03	587,984	570,859
日本リート投資法人	3.732	1,141,708	305,923	産業ファンド	1.214	583,579	480,708
イオンリート投資	9.019	1,088,030	120,637	Ｏｎｅリート投資法人	1.915	471,661	246,298
ケネディクス・オフィス投資法人	1.663	1,041,988	626,571	フロンティア不動産投資	0.75	349,251	465,668
三菱地所物流ＲＥＩＴ	3.726	1,041,750	279,589	三井不ロジパーク	0.941	335,006	356,011
森トラスト総合リート	5.539	1,011,002	182,524	プレミア投資法人	3	330,603	110,201

（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、2018年１月10日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド（39,732,652千口）の内容です。

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

ファンド名	2018年１月10日現在		
	口数	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	3.179	1,503,667	1.6
ＭＣＵＢＳ ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	10.865	850,729	0.9
森ヒルズリート	21.092	2,942,334	3.1
産業ファンド	2.786	1,374,891	1.5
アドバンス・レジデンス	8.48	2,378,640	2.5
ケネディクスレジデンシャル	4.219	1,366,956	1.5
ＡＰＩ投資法人	6.514	3,107,178	3.3
ＧＬＰ投資法人	20.393	2,551,164	2.7
コンフォリア・レジデンシャル	6.359	1,538,878	1.6
日本プロロジスリート	15.899	3,838,018	4.1
星野リゾート・リート	1.059	597,276	0.6
Ｏｎｅリート投資法人	2.218	558,270	0.6
イオンリート投資	18.019	2,173,091	2.3
ヒューリックリート投資法	10.198	1,675,531	1.8
日本リート投資法人	5.732	1,903,024	2.0
インベスコ・オフィス・Ｊリート	11.332	1,257,852	1.3
積水ハウス・リート投資	13.059	1,740,764	1.9
ケネディクス商業リート	7.264	1,770,963	1.9
ヘルスケア＆メディカル投資	1.675	183,747	0.2
ジャパン・シニアリビング	1.142	183,976	0.2
野村不動産マスターＦ	39.922	5,648,963	6.0
ラサールロジポート投資	13.499	1,579,383	1.7
三井不ロジパーク	0.222	80,697	0.1
大江戸温泉リート	9.864	857,181	0.9
投資法人みらい	5.3	962,480	1.0
森トラスト・ホテルリート投	1.029	148,999	0.2
三菱地所物流ＲＥＩＴ	3.726	1,023,904	1.1

ファンド名	2018年１月10日現在		
	口数	評価額	比率
	千口	千円	%
日本ビルファンド	8.943	5,043,852	5.4
ジャパンリアルエステイト	13.072	7,045,808	7.5
日本リテールファンド	15.272	3,159,776	3.4
オリックス不動産投資	21.199	3,349,442	3.6
日本プライムリアルティ	4.24	1,551,840	1.7
プレミア投資法人	10.773	1,195,803	1.3
グローバル・ワン不動産投資法人	0.549	221,796	0.2
ユナイテッド・アーバン投資法人	16.96	2,811,968	3.0
森トラスト総合リート	9.539	1,521,470	1.6
インヴィンシブル投資法人	31.062	1,501,847	1.6
フロンティア不動産投資	3.445	1,519,245	1.6
平和不動産リート	8.48	803,056	0.9
福岡リート投資法人	7.42	1,293,306	1.4
ケネディクス・オフィス投資法人	4.963	3,230,913	3.5
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	10.445	1,190,730	1.3
いちごオフィスリート投資法人	10.84	862,864	0.9
大和証券オフィス投資法人	2.48	1,490,480	1.6
阪急リート投資法人	1.325	174,502	0.2
スターツプロシード投資法人	2.149	361,246	0.4
大和ハウスリート投資法人	9.937	2,671,065	2.9
ジャパン・ホテル・リート投資法人	41.328	3,240,115	3.5
日本賃貸住宅投資法人	17.337	1,430,302	1.5
ジャパンエクセレント投資法人	12.72	1,671,408	1.8
合計 口数、金額	509.524	91,141,400	
合計 銘柄数<比率>	50銘柄		<97.6%>

（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。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の決算日（2017年10月16日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年１月10日）現在におけるダイワ北米好配当株マザーファンドの組入資産の内容等を61～63ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ北米好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 株　式

（2017年１月11日から2018年１月10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
TIME WARNER INC（アメリカ）	3.72	38,099	10,241	TIME WARNER INC（アメリカ）	3.658	39,635	10,835
AETNA INC（アメリカ）	2.494	35,478	14,225	HONEYWELL INTERNATIONAL INC（アメリカ）	2.542	38,311	15,071
ORACLE CORP（アメリカ）	6.269	35,079	5,595	QUALCOMM INC（アメリカ）	6.206	36,265	5,843
WAL-MART STORES INC（アメリカ）	3.35	33,562	10,018	CVS HEALTH CORP（アメリカ）	4	32,376	8,094
INTL BUSINESS MACHINES CORP（アメリカ）	1.789	30,488	17,042	CSX CORP（アメリカ）	6.308	32,195	5,103
GENERAL ELECTRIC CO（アメリカ）	9.589	28,637	2,986	ALTRIA GROUP INC（アメリカ）	4.101	31,109	7,585
HALLIBURTON CO（アメリカ）	5.644	28,448	5,040	AETNA INC（アメリカ）	1.693	30,826	18,208
EVEREST RE GROUP LTD（バミューダ）	1	26,963	26,963	INTEL CORP（アメリカ）	6.612	30,325	4,586
INTEL CORP（アメリカ）	6.612	26,622	4,026	WESTERN DIGITAL CORP（アメリカ）	2.92	27,095	9,279
VIACOM INC-CLASS B（アメリカ）	4.508	22,623	5,018	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC（アメリカ）	1.946	26,490	13,612

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

買				売			
銘柄	証券数	金額	平均単価	銘柄	証券数	金額	平均単価
	千証券	千円	円		千証券	千円	円
NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A.（アメリカ）	7.025	20,059	2,855	CITIGROUP INC 7.125 J（アメリカ）	7.525	24,259	3,223
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6 H（アメリカ）	6.725	19,698	2,929	NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A.（アメリカ）	6.422	20,847	3,246
MORGAN STANLEY 5.85 K（アメリカ）	6.8	19,619	2,885	HUNTINGTON BANCSHARES 6.25 D（アメリカ）	5.5	16,862	3,065
DTE ENERGY CO 6 F（アメリカ）	5.025	14,695	2,924	WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q（アメリカ）	5.178	15,749	3,041
BANK OF AMERICA CORP 6 EE（アメリカ）	4.575	13,339	2,915	CHARLES SCHWAB CORP 5.95 D（アメリカ）	5.2	15,300	2,942
VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B（アメリカ）	4.375	12,696	2,902	ASPEN INSURANCE HLDG LTD 5.625 *（バミューダ）	5.175	14,741	2,848
SCE TRUST III 5.75 H（アメリカ）	3.602	10,828	3,006	SOUTHERN CO 6.25（アメリカ）	4.796	14,327	2,987
REINSURANCE GRP OF AMER 6.2（アメリカ）	3.375	10,821	3,206	WELLS FARGO & COMPANY 6 V（アメリカ）	3.675	10,989	2,990
CITIGROUP INC 6.3 S（アメリカ）	3.5	10,320	2,948	EBAY INC 6（アメリカ）	3.684	10,801	2,932
ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *（アメリカ）	3.625	9,825	2,710	DTE ENERGY CO 6 F（アメリカ）	3.4	10,343	3,042

（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、2018年１月10日現在におけるダイワ北米好配当株マザーファンド（835,469千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	2018年１月10日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ABBOTT LABORATORIES	37	218	24,514	ヘルスケア
AETNA INC	13.07	239	26,984	ヘルスケア
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6.18	104	11,748	素材
TE CONNECTIVITY LTD	24.35	240	27,058	情報技術
APPLE INC	27.89	486	54,673	情報技術
VERIZON COMMUNICATIONS INC	35	180	20,312	電気通信サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	25	154	17,387	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	32	348	39,240	金融
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9	156	17,617	金融
FIRST AMERICAN FINANCIAL	30.27	180	20,297	金融
CISCO SYSTEMS INC	90	357	40,168	情報技術
MORGAN STANLEY	35	186	20,977	金融
BROADCOM LTD	5.28	141	15,941	情報技術
TIME WARNER INC	37.2	343	38,602	一般消費財・サービス
TELEFLEX INC	3.79	99	11,172	ヘルスケア
EXPEDIA INC	11.24	143	16,087	一般消費財・サービス
EXXON MOBIL CORP	28.53	247	27,837	エネルギー
EVEREST RE GROUP LTD	10	216	24,396	金融
NEXTERA ENERGY INC	13	197	22,196	公益事業
GENERAL ELECTRIC CO	95.89	177	20,012	資本財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	6.55	134	15,164	資本財・サービス
GAMESTOP CORP-CLASS A	36.15	70	7,947	一般消費財・サービス
ALPHABET INC-CL A	5.75	639	71,951	情報技術
HALLIBURTON CO	56.44	294	33,072	エネルギー
HOME DEPOT INC	8.96	173	19,455	一般消費財・サービス
NXP SEMICONDUCTORS NV	17.52	207	23,336	情報技術
TRINSEO SA	18.9	145	16,364	素材
INTL BUSINESS MACHINES CORP	17.89	293	32,958	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	22	135	15,212	素材
JOHNSON & JOHNSON	20	288	32,417	ヘルスケア
DOWDUPONT INC	19.27	145	16,325	素材
DELPHI TECHNOLOGIES PLC	3.33	19	2,164	一般消費財・サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	5	155	17,451	資本財・サービス
APTIV PLC	10	92	10,429	一般消費財・サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	26	194	21,895	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	20.27	141	15,857	生活必需品
PFIZER INC	80	291	32,754	ヘルスケア
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9	160	18,009	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	33.41	304	34,207	生活必需品
ACCENTURE PLC-CL A	23	366	41,241	情報技術
ROSS STORES INC	12.82	103	11,606	一般消費財・サービス
SCHLUMBERGER LTD	31.7	237	26,699	エネルギー
AT&T INC	81.52	305	34,366	電気通信サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	20	258	29,036	資本財・サービス
ANTHEM INC	7.55	177	19,922	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	20	219	24,725	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	37	230	25,904	金融
WAL-MART STORES INC	33.5	336	37,817	生活必需品
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	9.91	146	16,472	金融
ORACLE CORP	62.69	307	34,584	情報技術
BANK OF AMERICA CORP	130	393	44,250	金融
ANALOG DEVICES INC	15.7	143	16,178	情報技術
ALASKA AIR GROUP INC	22	156	17,636	資本財・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	18.99	105	11,855	エネルギー
EATON CORP PLC	18	147	16,593	資本財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	34.4	189	21,263	金融
SNAP-ON INC	12	214	24,121	資本財・サービス
MICROSOFT CORP	55	485	54,561	情報技術
MEDTRONIC PLC	17	145	16,417	ヘルスケア
CHUBB LTD	22	320	36,081	金融
ZIONS BANCORPORATION	33.38	172	19,447	金融
BIOGEN INC	6	201	22,694	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	47	278	31,277	一般消費財・サービス
アメリカ・ドル通貨計 株数、金額	1,757.29	13,952	1,568,962	
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	63銘柄		<71.1%>	
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円	
SUNCOR ENERGY INC	46	216	19,494	エネルギー
BANK OF NOVA SCOTIA	20	165	14,944	金融
ROYAL BANK OF CANADA	18	188	17,016	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	25	184	16,640	一般消費財・サービス
ENBRIDGE INC	25	125	11,309	エネルギー
カナダ・ドル通貨計 株数、金額	134	880	79,406	
カナダ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	5銘柄		< 3.6%>	
ファンド合計 株数、金額	1,891.29	－	1,648,368	
ファンド合計 銘柄数<比率>	68銘柄		<74.7%>	

(注１) 邦貨換算金額は、2018年１月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注２) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注３) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

銘柄	2018年1月10日現在		
	証券数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千証券	千アメリカ・ドル	千円
JPMORGAN CHASE & CO 6.125 Y	3.2	84	9,546
CHS INC 7.5 4	5.9	165	18,649
JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA	5.225	140	15,752
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.2 F	2.025	53	6,063
WELLS FARGO & COMPANY 6 V	1.702	45	5,090
SOUTHERN CO 6.25	1.654	44	5,016
AMERICAN FINANCIAL GROUP 6	1.5	39	4,449
WELLS FARGO & COMPANY 5.7 W	2.979	77	8,696
BANK OF AMERICA CORP 6.2 CC	3.957	107	12,089
CITIGROUP INC 6.3 S	7.3	194	21,917
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.3 N	1.973	53	6,067
EBAY INC 6	0.666	17	2,022
BERKLEY (WR) CORPORATION 5.9	2.05	53	6,014
BANK OF AMERICA CORP 6 EE	6.755	181	20,395
BERKLEY (WR) CORPORATION 5.75	4.411	114	12,841
VALIDUS HOLDINGS LTD 5.875 A	0.7	17	2,019
WELLS FARGO & COMPANY 5.5 X	2.48	63	7,144
STIFEL FINANCIAL CORP 6.25 A	2.873	76	8,590
DOMINION ENERGY INC 5.25 A	0.836	20	2,353
LEGG MASON INC 5.45	4.3	108	12,175
ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	1.9	47	5,328
ARCH CAPITAL GROUP LTD 5.25 E	1.825	45	5,126
MORGAN STANLEY 5.85 K	6.8	182	20,523
DTE ENERGY CO 6 F	1.625	43	4,913
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	1.575	39	4,464
NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A.	0.603	17	1,944
NUSTAR ENERGY LP 7.625 B	0.705	16	1,886
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6 H	6.725	181	20,448
VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B	2.051	53	6,056
TCF FINANCIAL CO 5.7 C	1.45	37	4,188
GEORGIA POWER CO 5 2017	1.475	37	4,178
SOUTHERN CO 5.25	1.425	35	4,022
BANK OF AMERICA CORP 6.5 Y	1.975	52	5,936
FIRST REPUBLIC BANK/SF 5.5 D	2.9	73	8,224
HANOVER INSURANCE GROUP 6.35	2.1	52	5,957
WELLS FARGO & COMPANY 5.2	2.125	53	6,000
ASPEN INSURANCE HLDG LTD 5.95	1.4	38	4,288
CITIGROUP INC 6.875 K	1.214	34	3,908
SCE TRUST III 5.75 H	3.602	97	10,932
CITIGROUP CAPITAL XIII 7.75009	2.275	62	7,076
PARTNERRE LTD 6.5 G	4.576	122	13,728
MORGAN STANLEY 6.875 F	2.707	77	8,669
ALLY FINANCIAL 7.20086 2/15/40	6.575	171	19,238
BB&T CORPORATION 5.85	1	25	2,856
QWEST CORP 7	1.249	29	3,323
BB&T CORPORATION 5.625 E	2.897	73	8,222
MORGAN STANLEY 6.375 I	3.325	91	10,259
NUSTAR LOGISTICS LP 7.625	4.275	108	12,147
REINSURANCE GRP OF AMER 6.2	3.375	93	10,516
STATE STREET CORP 5.25 C	2.525	63	7,126
STATE STREET CORP 5.9 D	4.4	118	13,373
WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	1.638	44	4,958
CITIGROUP INC 7.125 J	0.638	18	2,063
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.7 D	2.1	56	6,331
合計 証券数、金額	149.516	3,958	445,118
合計 銘柄数<比率>	54銘柄		<20.2%>

(注1) 邦貨換算金額は、2018年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託証券

銘柄	2018年1月10日現在		
	口数	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
SUNSTONE HOTEL INVESTORS 6.95 E	0.793	20	2,340
AMERICAN HOMES 4 RENT 6.5 D	0.563	15	1,706
AMERICAN HOMES 4 RENT 6.35 E	1.5	39	4,444
MONMOUTH REIT 6.125 C	1.525	38	4,312
NATIONAL RETAIL PROP INC 5.2 F	0.597	14	1,678
COLONY NORTHSTAR INC 8.75 E	1.75	46	5,258
COLONY NORTHSTAR INC 7.15 I	0.7	17	1,991
GLOBAL NET LEASE INC 7.25 A	1.1	28	3,152
NATIONAL STORAGE AFFILIA 6 A	2.55	65	7,386
NATIONAL RETAIL PROP INC 5.7 E	1.058	26	3,029
GRAMERCY PROPERTY TRUST 7.125 A	1.7	44	5,033
DDR CORP 6.5 J	1	25	2,829
VEREIT INC 6.7 F	1.401	36	4,077
合計 口数、金額	16.237	420	47,240
合計 銘柄数<比率>	13銘柄		<2.1%>

(注1) 邦貨換算金額は、2018年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の決算日（2017年10月16日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年１月10日）現在におけるダイワ欧州好配当株マザーファンドの組入資産の内容等を64～65ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄

株　式

（2017年１月11日から2018年１月10日まで）

買			付	
銘柄	株数	金額	平均単価	
	千株	千円	円	
DIXONS CARPHONE PLC（イギリス）	43.909	20,130	458	
VODAFONE GROUP PLC（イギリス）	28.988	9,852	339	
INTESA SANPAOLO（イタリア）	10.981	4,199	382	
ENEL SPA（イタリア）	7.06	4,000	566	
CASINO GUICHARD PERRACHON（フランス）	0.407	2,724	6,693	
ENI SPA（イタリア）	0.926	1,721	1,859	

売			付	
銘柄	株数	金額	平均単価	
	千株	千円	円	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B（スウェーデン）	10.734	38,261	3,564	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC（イギリス）	2.117	21,704	10,252	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC（イギリス）	2.217	16,847	7,599	
NESTLE SA-REG（スイス）	1.827	16,118	8,822	
BNP PARIBAS（フランス）	1.997	15,306	7,664	
NOKIA OYJ（フィンランド）	24.58	13,764	559	
ALLIANZ SE-REG（ドイツ）	0.545	13,005	23,862	
DIXONS CARPHONE PLC（イギリス）	43.909	12,018	273	
CTT-CORREIOS DE PORTUGAL（ポルトガル）	20.773	11,934	574	
ATLAS COPCO AB-B SHS（スウェーデン）	3.318	10,868	3,275	

（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、2018年１月10日現在におけるダイワ欧州好配当株マザーファンド（779,893千口）の内容です。

外国株式

銘柄		2018年１月10日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
（イギリス）		百株	千イギリス・ポンド	千円	
PRUDENTIAL PLC		148.44	283	43,095	金融
AVIVA PLC		406.69	209	31,943	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC		159	214	32,583	ヘルスケア
VODAFONE GROUP PLC		966.42	230	34,998	電気通信サービス
KINGFISHER PLC		307.51	104	15,950	一般消費財・サービス
NATIONAL GRID PLC		203.12	172	26,292	公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		50.47	250	38,086	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		434.04	332	50,609	金融
CARNIVAL PLC		31.11	153	23,289	一般消費財・サービス
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		117.61	298	45,365	エネルギー
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額	2,824.41	2,249	342,214	
	銘柄数<比率>	10銘柄		<25.1%>	
（スイス）		百株	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		10.29	257	29,380	ヘルスケア
NESTLE SA-REG		58.58	494	56,511	生活必需品
ZURICH INSURANCE GROUP AG		10.34	319	36,484	金融
NOVARTIS AG-REG		43.89	372	42,621	ヘルスケア
GIVAUDAN-REG		1.38	313	35,837	素材
スイス・フラン通貨計	株数、金額	124.48	1,757	200,834	
	銘柄数<比率>	5銘柄		<14.8%>	

銘柄		2018年１月10日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
（ノルウェー）		百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
DNB ASA		142.81	2,253	31,234	金融
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額	142.81	2,253	31,234	
	銘柄数<比率>	1銘柄		<2.3%>	
（スウェーデン）		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
NORDEA BANK AB		180.77	1,837	25,082	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		110.86	2,272	31,021	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額	291.63	4,110	56,103	
	銘柄数<比率>	2銘柄		<4.1%>	
ユーロ（オランダ）		百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE PHILIPS NV		83.94	278	37,418	ヘルスケア
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		65.06	118	15,932	生活必需品
KONINKLIJKE DSM NV		37.98	313	42,046	素材
KONINKLIJKE KPN NV		633.42	183	24,649	電気通信サービス
国小計	株数、金額	820.4	894	120,047	
	銘柄数<比率>	4銘柄		<8.8%>	
ユーロ（フランス）		百株	千ユーロ	千円	
TOTAL SA		62.99	304	40,826	エネルギー
SCHNEIDER ELECTRIC SE		46.76	348	46,734	資本財・サービス
BNP PARIBAS		39.9	261	35,032	金融

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

銘柄		2018年1月10日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
CASINO GUICHARD PERRACHON		38.7	199	26,796	生活必需品
SANOFI		36.82	273	36,681	ヘルスケア
国小計	株数、金額	225.17	1,386	186,070	
	銘柄数<比率>	5銘柄		<13.7%>	
ユーロ（ドイツ）		百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS AG-REG		24.89	302	40,614	資本財・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		29.96	270	36,263	一般消費財・サービス
BASF SE		32.18	304	40,893	素材
ALLIANZ SE-REG		10.74	215	28,888	金融
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		11.83	220	29,630	金融
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		211.45	316	42,519	電気通信サービス
国小計	株数、金額	321.05	1,630	218,809	
	銘柄数<比率>	6銘柄		<16.1%>	
ユーロ（スペイン）		百株	千ユーロ	千円	
ENAGAS SA		101.15	244	32,752	エネルギー
国小計	株数、金額	101.15	244	32,752	
	銘柄数<比率>	1銘柄		< 2.4%>	
ユーロ（イタリア）		百株	千ユーロ	千円	
INTESA SANPAOLO		682.43	193	26,007	金融
ENI SPA		148.49	215	28,892	エネルギー
ENEL SPA		481.53	256	34,408	公益事業
国小計	株数、金額	1,312.45	665	89,308	
	銘柄数<比率>	3銘柄		< 6.6%>	
ユーロ（フィンランド）		百株	千ユーロ	千円	
NOKIA OYJ		231.25	94	12,744	情報技術
国小計	株数、金額	231.25	94	12,744	
	銘柄数<比率>	1銘柄		< 0.9%>	
ユーロ通貨計	株数、金額	3,011.47	4,916	659,732	
	銘柄数<比率>	20銘柄		<48.5%>	
ファンド合計	株数、金額	6,394.8	－	1,290,119	
	銘柄数<比率>	38銘柄		<94.8%>	

（注1）邦貨換算金額は、2018年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
（注2）＜　＞内は純資産総額に対する評価額の比率。
（注3）評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の決算日（2017年10月16日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年１月10日）現在におけるダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの組入資産の内容等を66～67ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄

株　式

（2017年１月11日から2018年１月10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
NETEASE INC-ADR（ケイマン諸島）	2.8	90,065	32,166	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC（台湾）	120	91,533	762
TENCENT HOLDINGS LTD（ケイマン諸島）	16.2	57,672	3,560	WOODSIDE PETROLEUM LTD（オーストラリア）	30	78,956	2,631
DBS GROUP HOLDINGS LTD（シンガポール）	32.7	56,455	1,726	NETEASE INC-ADR（ケイマン諸島）	2.4	77,440	32,266
WOODSIDE PETROLEUM LTD（オーストラリア）	18	48,637	2,702	SK HYNIX INC（韓国）	13.3	70,441	5,296
SK HYNIX INC（韓国）	8.8	48,146	5,471	DBS GROUP HOLDINGS LTD（シンガポール）	38.2	60,212	1,576
ASM PACIFIC TECHNOLOGY（ケイマン諸島）	35.9	46,418	1,292	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD（韓国）	0.275	58,322	212,081
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD（韓国）	0.21	44,165	210,311	TENCENT HOLDINGS LTD（ケイマン諸島）	17.3	57,801	3,341
BHP BILLITON LIMITED（オーストラリア）	18.1	38,770	2,142	MITAC HOLDINGS CORP（台湾）	438.554	53,969	123
MITAC HOLDINGS CORP（台湾）	289	38,310	132	ASM PACIFIC TECHNOLOGY（ケイマン諸島）	35.9	53,340	1,485
CNOOC LTD（香港）	290	36,639	126	AMCOR LIMITED（オーストラリア）	33.5	44,107	1,316

（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、2018年１月10日現在におけるダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド（401,541千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	2018年１月10日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	10	103	11,639	一般消費財・サービス
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	10	190	21,455	情報技術
WEIBO CORP-SPON ADR	7	85	9,578	情報技術
SILICON MOTION TECHNOL-ADR	21	118	13,339	情報技術
NETEASE INC-ADR	4	135	15,250	情報技術
アメリカ・ドル通貨計 株数、金額	52	633	71,263	
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	5銘柄		<7.5%>	
(オーストラリア)	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
BHP BILLITON LIMITED	135	419	36,848	素材
SOUTH32 LTD	130	48	4,261	素材
ALUMINA LTD	820	207	18,231	素材
OZ MINERALS LTD	210	192	16,886	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	56	165	14,576	金融
CYBG PLC - CDI	51	28	2,545	金融
WESTPAC BANKING CORP	90	283	24,953	金融
AUST AND NZ BANKING GROUP	60	173	15,259	金融
RIO TINTO LTD	50	399	35,094	素材
AMCOR LIMITED	60	90	7,988	素材
TREASURY WINE ESTATES LTD	130	199	17,570	生活必需品
QBE INSURANCE GROUP LTD	115	121	10,651	金融
QANTAS AIRWAYS LTD	290	140	12,385	資本財・サービス
BORAL LTD	235	182	16,046	素材
DOWNER EDI LTD	200	141	12,408	資本財・サービス
ORORA LTD	250	84	7,403	素材
オーストラリア・ドル通貨計 株数、金額	2,882	2,880	253,114	
オーストラリア・ドル通貨計 銘柄数<比率>	16銘柄		<26.5%>	
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	350	945	13,589	一般消費財・サービス
CHINA GAS HOLDINGS LTD	280	579	8,334	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	30	807	11,604	金融
TENCENT HOLDINGS LTD	39	1,730	24,889	情報技術
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	180	736	10,586	素材
PC PARTNER GROUP LTD	2,300	979	14,089	情報技術
AIA GROUP LTD	150	994	14,300	金融
KWG PROPERTY HOLDING LTD	800	942	13,551	不動産
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	135	1,138	16,365	金融
BBMG CORP-H	1,400	561	8,072	素材
SUNNY OPTICAL TECH	60	613	8,826	情報技術

銘柄		2018年1月10日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千香港ドル	千円	
YESTAR HEALTHCARE HOLDINGS		1,765	570	8,197	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-H		270	661	9,512	金融
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE		300	630	9,059	一般消費財・サービス
香港ドル通貨計	株数、金額	8,059	11,890	170,980	
	銘柄数<比率>	14銘柄		<17.9%>	
(シンガポール)		百株	千シンガポール・ドル	千円	
DBS GROUP HOLDINGS LTD		95	251	21,195	金融
CAPITALAND LTD		265	100	8,430	不動産
MM2 ASIA LTD		2,000	109	9,173	一般消費財・サービス
SUNNINGDALE TECH LTD		250	48	4,039	資本財・サービス
GENTING SINGAPORE PLC		650	87	7,330	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD		67	144	12,162	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		370	134	11,303	電気通信サービス
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額	3,697	874	73,635	
	銘柄数<比率>	7銘柄		<7.7%>	
(台湾)		百株	千台湾ドル	千円	
RICHWAVE TECHNOLOGY CORP		280	2,402	9,153	情報技術
PRIMAX ELECTRONICS LTD		360	2,854	10,876	情報技術
PIXART IMAGING INC		200	2,650	10,096	情報技術
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO		270	2,378	9,062	情報技術
CHROMA ATE INC		240	3,840	14,630	情報技術
GLOBAL PMX CO LTD		210	3,486	13,281	一般消費財・サービス
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP		60	3,000	11,430	資本財・サービス
HIWIN TECHNOLOGIES CORP		90	3,087	11,761	資本財・サービス
ACCTON TECHNOLOGY CORP		400	4,760	18,135	情報技術
MERRY ELECTRONICS CO LTD		110	2,145	8,172	情報技術
MEDIATEK INC		250	7,600	28,956	情報技術
GOURMET MASTER CO LTD		121	4,846	18,463	一般消費財・サービス
FUBON FINANCIAL HOLDING CO		640	3,360	12,801	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO		630	3,515	13,393	金融
WIN SEMICONDUCTORS CORP		120	3,360	12,801	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC		100	2,420	9,220	情報技術
台湾ドル通貨計	株数、金額	4,081	55,705	212,237	
	銘柄数<比率>	16銘柄		<22.3%>	
(韓国)		百株	千韓国ウォン	千円	
POSCO		2.1	79,275	8,331	素材
VIATRON TECHNOLOGIES INC		22	44,330	4,659	情報技術
LOEN ENTERTAINMENT INC		7.5	77,250	8,118	一般消費財・サービス
CJ E&M CORP		5	45,450	4,776	一般消費財・サービス
KB FINANCIAL GROUP INC		10	67,200	7,062	金融
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD		2.7	680,400	71,510	情報技術
KOREA ELECTRIC POWER CORP		16	59,680	6,272	公益事業
MODETOUR NETWORK INC		24	76,680	8,059	一般消費財・サービス
HANA FINANCIAL GROUP		14	76,440	8,033	金融
韓国ウォン通貨計	株数、金額	103.3	1,206,705	126,824	
	銘柄数<比率>	9銘柄		<13.3%>	
ファンド合計	株数、金額	18,874.3	－	908,055	
	銘柄数<比率>	67銘柄		<95.2%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2018年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄		2018年1月10日現在 □数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額
(オーストラリア)		千口	千オーストラリア・ドル	千円
MIRVAC GROUP		35	81	7,166
合計	□数、金額	35	81	7,166
	銘柄数<比率>	1銘柄		<0.8%>

(注1) 邦貨換算金額は、2018年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の決算日（2017年10月16日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年１月10日）現在におけるダイワ好配当日本株マザーファンドの組入資産の内容等を68～69ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ好配当日本株マザーファンドの主要な売買銘柄

株　式

（2017年１月11日から2018年１月10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
東京エレクトロン	44	720,286	16,370	日本電信電話	210	1,083,103	5,157
任天堂	14	510,519	36,465	三井住友フィナンシャルG	221.2	933,843	4,221
昭和電工	188.5	494,288	2,622	三菱ＵＦＪフィナンシャルG	1,162.7	820,409	705
住友鉱山	257.5	492,350	1,912	東京エレクトロン	35	675,296	19,294
三井物産	280	475,845	1,699	ＮＴＴドコモ	252.5	665,086	2,634
ソフトバンクグループ	38.5	335,084	8,703	あおぞら銀行	1,327.5	657,494	495
ディスコ	18	334,592	18,588	任天堂	14.5	553,468	38,170
ツバキ・ナカシマ	157.5	333,114	2,115	本田技研	172.5	546,768	3,169
旭硝子	322.5	299,884	929	Ｔ＆Ｄホールディングス	332.5	529,761	1,593
ファーストリテイリング	7	282,103	40,300	トヨタ自動車	79.4	512,244	6,451

（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、2018年１月10日現在におけるダイワ好配当日本株マザーファンド（6,857,276千口）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2018年１月10日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
建設業（2.8%）		
大和ハウス	120	543,840
関電工	35	42,000
食料品（0.2%）		
日本たばこ産業	10	36,390
繊維製品（0.4%）		
東レ	50	56,275
サカイオーベックス	9	24,885
化学（11.4%）		
昭和電工	78.5	401,920
住友化学	315	273,105
クレハ	11.5	93,610
東亞合成	57.5	85,215
デンカ	30	138,150
信越化学	15	180,900
日本化学工業	10.2	26,520
カネカ	85	92,820
三井化学	25	95,625
ＪＳＲ	35	80,815
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	180	232,020
住友ベークライト	85	84,235
宇部興産	32.5	112,775
旭有機材	17.5	37,992
ダイキアクシス	17.5	28,542
扶桑化学工業	12.5	38,562
花王	15	115,560
三洋化成	6.5	39,780
ポーラ・オルビスＨＤ	22.5	90,562
天馬	7.5	16,807
東リ	20	8,900
パーカーコーポレーション	135	93,960
医薬品（2.3%）		
武田薬品	7.5	49,995
アステラス製薬	50	73,000
小野薬品	30	80,640
沢井製薬	25	128,250
大塚ホールディングス	30	152,490
石油・石炭製品（2.0%）		
ビーピー・カストロール	15	31,845
出光興産	22.5	101,250
ＪＸＴＧホールディングス	300	232,830
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	10	47,650
ゴム製品（0.3%）		
ブリヂストン	10	53,330
ガラス・土石製品（4.0%）		
旭硝子	27.5	138,325
住友大阪セメント	175	99,575
太平洋セメント	20	97,200
ノザワ	80	119,680
東海カーボン	100	156,300
品川リフラクトリーズ	25	83,875
フジミインコーポレーテッド	30	73,380
ニチアス	50	75,600
鉄鋼（0.2%）		
新日本電工	100	49,800
非鉄金属（7.4%）		
大紀アルミニウム	35	31,045
日本軽金属ＨＤ	375	122,625
三井金属	46	320,620
東邦亜鉛	20	131,600
三菱マテリアル	12.5	51,375
住友鉱山	115	625,945
ＵＡＣＪ	32.5	98,637
古河電工	7.5	45,075
住友電工	62.5	123,593
機械（6.5%）		
東芝機械	135	121,095
アイダエンジニア	132.5	193,450
旭ダイヤモンド	7.5	9,840

銘柄	2018年1月10日現在 株数	評価額
	千株	千円
DMG森精機	70	171,710
住友重機械	25	126,000
荏原実業	15	30,495
三精テクノロジーズ	75	93,750
酒井重工業	12.5	55,125
タダノ	50	103,500
キトー	57.5	104,190
アマノ	17.5	53,900
ツバキ・ナカシマ	45	126,135
日本精工	95	175,940
電気機器（5.7%）		
三菱電機	135	273,577
日本電産	10.5	177,082
愛知電機	30	103,200
富士通	65	54,073
マクセルホールディングス	67.5	169,222
ユニデンホールディングス	175	55,125
レーザーテック	10	35,150
村田製作所	7.5	117,300
東京エレクトロン	9	196,830
輸送用機器（10.6%）		
デンソー	46	326,232
東海理化電機	17.5	42,420
日産自動車	115	132,997
いすゞ自動車	37.5	73,518
トヨタ自動車	70	539,420
日野自動車	70	105,560
三菱自動車工業	540	478,980
武蔵精密工業	17.5	65,362
マツダ	35	55,440
本田技研	75	307,650
ＳＵＢＡＲＵ	25	92,250
精密機器（0.1%）		
東京精密	5	23,875
その他製品（1.9%）		
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	25	95,750
桑山	29.2	18,892
ＮＩＳＳＨＡ	10	35,950
任天堂	5.5	243,265
陸運業（1.4%）		
西武ホールディングス	65	141,635
ＳＧホールディングス	65	149,760
空運業（0.6%）		
日本航空	30	132,720
情報・通信業（3.2%）		
トレンドマイクロ	14	92,400
WOWOW	21.5	72,132
日本電信電話	42.5	228,480
ＮＴＴドコモ	32.5	87,181
ソフトバンクグループ	20	184,060
卸売業（14.0%）		
双日	300	108,000
アルコニックス	55	133,705
ダイワボウＨＤ	20	97,400
三洋貿易	12	33,744

銘柄	2018年1月10日現在 株数	評価額
	千株	千円
ヤギ	2.5	6,442
萩原電気	20	73,300
伊藤忠	315	691,425
豊田通商	30	143,400
三井物産	212.5	411,187
日立ハイテクノロジーズ	2.5	12,237
住友商事	157.5	315,630
三菱商事	215	701,115
伊藤忠エネクス	15	16,620
日鉄住金物産	15	103,800
東テク	27.5	82,115
小売業（1.5%）		
ＢＥＥＮＯＳ	27.5	51,700
ヤマダ電機	140	88,760
ファーストリテイリング	3.5	163,800
銀行業（11.6%）		
あおぞら銀行	32.5	149,012
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	970	850,496
りそなホールディングス	140	101,486
三井住友トラストＨＤ	22.5	105,547
三井住友フィナンシャルＧ	174	900,798
みずほフィナンシャルＧ	1,450	311,750
証券、商品先物取引業（1.4%）		
ＳＢＩホールディングス	17.5	46,760
野村ホールディングス	340	246,398
保険業（4.9%）		
ＳＯＭＰＯホールディングス	36	164,196
ＭＳ＆ＡＤ	62.5	243,562
第一生命ＨＬＤＧＳ	70	171,675
東京海上ＨＤ	54	293,166
Ｔ＆Ｄホールディングス	70	141,995
その他金融業（2.5%）		
日立キャピタル	32.5	98,800
オリックス	142.5	292,410
三菱ＵＦＪリース	175	124,075
不動産業（1.3%）		
三井不動産	40	114,300
住友不動産	30	124,290
シノケングループ	10	24,820
サービス業（1.9%）		
ＧＣＡ	40	45,600
アウトソーシング	10	19,410
電通	25	122,875
日本ハウズイング	9.2	29,348
テクノプロ・ホールディング	2.5	15,425
ソラスト	25	68,650
東京ドーム	75	85,050
	千株	千円
合計 株数、金額	11,538.6	20,866,198
合計 銘柄数<比率>	145銘柄	<92.5%>

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

(2) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別		2018年1月10日現在 買建額	売建額
		百万円	百万円
国内	TOPIX	1,041	－

（注）単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書　第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）

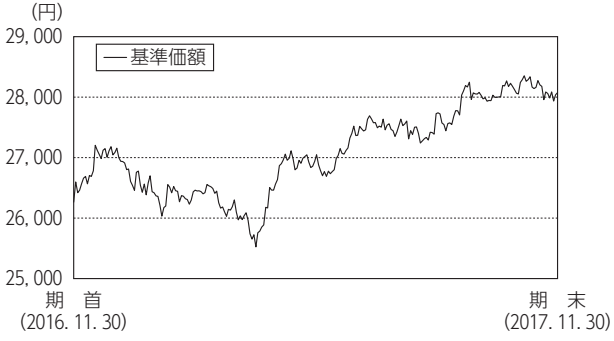
外国債券インデックスマザーファンドの第18期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★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。 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（除く日本、ヘッジなし・円ベース）		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首) 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。

◆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	7
（保管費用）	(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
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 142,447	千アメリカ・ドル 108,195 (—)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 11,707	千カナダ・ドル 9,089 (—)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 6,963	千オーストラリア・ドル 3,410 (—)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,239	千シンガポール・ドル 1,107 (—)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 5,106	千イギリス・ポンド 7,409 (—)
	スイス	国債証券	千スイス・フラン —	千スイス・フラン 627 (—)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 5,847	千デンマーク・クローネ 10,152 (—)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 4,526	千ノルウェー・クローネ — (—)
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローネ 5,410	千スウェーデン・クローネ 1,760 (—)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 38,113	千メキシコ・ペソ 32,351 (—)
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 3,609	千マレーシア・リンギット 3,954 (—)
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 15,299	千南アフリカ・ランド 3,976 (—)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 7,467	千ポーランド・ズロチ 6,970 (—)
	ユーロ（アイルランド）	国債証券	千ユーロ 1,150	千ユーロ 797 (—)
	ユーロ（オランダ）	国債証券	千ユーロ 2,437	千ユーロ 4,447 (—)
	ユーロ（ベルギー）	国債証券	千ユーロ 3,292	千ユーロ 2,793 (—)
	ユーロ（フランス）	国債証券	千ユーロ 15,244	千ユーロ 10,831 (—)
	ユーロ（ドイツ）	国債証券	千ユーロ 11,220	千ユーロ 13,064 (—)
	ユーロ（スペイン）	国債証券	千ユーロ 10,791	千ユーロ 8,418 (—)
	ユーロ（イタリア）	国債証券	千ユーロ 14,662	千ユーロ 13,153 (—)
	ユーロ（フィンランド）	国債証券	千ユーロ 570	千ユーロ 432 (—)
	ユーロ（オーストリア）	国債証券	千ユーロ 2,661	千ユーロ 1,802 (—)
	ユーロ（ユーロ通貨計）	国債証券	千ユーロ 62,031	千ユーロ 55,742 (—)

（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 買付 銘柄	金額	当期 売付 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 区分	当期末 額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率 5年以上	2年以上	2年未満
	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	626,026	632,164	70,834,003	42.5	—	17.7	16.6	8.2
	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ	37,381	40,103	3,492,978	2.1	—	0.9	0.7	0.5
	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	38,134	41,065	3,485,224	2.1	—	1.3	0.5	0.2
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
シンガポール	7,117	7,446	619,502	0.4	—	0.2	0.1	0.1
	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
イギリス	60,444	75,999	11,425,072	6.9	—	5.0	1.5	0.4
	千スイス・フラン	千スイス・フラン						
スイス	2,187	2,587	294,510	0.2	—	0.1	0.1	0.0
	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ						
デンマーク	48,636	60,118	1,072,508	0.6	—	0.4	0.1	0.1
	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ						
ノルウェー	32,577	34,557	469,287	0.3	—	0.2	0.1	0.1
	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ						
スウェーデン	50,850	57,615	770,894	0.5	—	0.2	0.2	0.1
	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ						
メキシコ	225,127	231,806	1,397,790	0.8	—	0.5	0.3	0.1
	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	26,889	26,874	736,885	0.4	—	0.2	0.1	0.1
	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド						
南アフリカ	116,723	102,959	844,266	0.5	—	0.4	0.0	0.0
	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ						
ポーランド	31,917	32,731	1,034,302	0.6	—	0.2	0.3	0.1

作成期		当期末							
区分		額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
			外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
		千ユーロ	千ユーロ	千円	%	%	%	%	%
ユーロ	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	千ユーロ 23,054	千ユーロ 27,284	3,623,622	2.2	—	1.4	0.6	0.2
	ベルギー	千ユーロ 26,235	千ユーロ 32,088	4,261,666	2.6	—	1.8	0.5	0.2
	フランス	千ユーロ 108,392	千ユーロ 128,181	17,023,784	10.2	—	6.4	2.6	1.3
	ドイツ	千ユーロ 76,126	千ユーロ 89,437	11,878,234	7.1	—	4.1	2.1	0.9
	スペイン	千ユーロ 61,672	千ユーロ 71,965	9,557,727	5.7	—	3.7	1.3	0.7
	イタリア	千ユーロ 107,051	千ユーロ 123,182	16,359,857	9.8	—	5.7	3.0	1.1
	フィンランド	千ユーロ 6,863	千ユーロ 7,614	1,011,296	0.6	—	0.4	0.2	0.0
	オーストリア	千ユーロ 16,667	千ユーロ 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）

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
			%	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

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	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

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	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

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	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

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	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

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	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	244銘柄						
	金額				626,026	632,164	70,834,003	
					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	325	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	32銘柄						
	金額				37,381	40,103	3,492,978	
					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	2,455	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

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	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	
					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	3.2500	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	
					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	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

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	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	
					千スイス・フラン	千スイス・フラン		
スイス		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	404	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	
					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	11,512	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		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,164	3,192	56,956	2018/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,600	2,613	46,620	2027/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,534	27,371	2020/11/15
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金額				48,636	60,118	1,072,508	
					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	7,075	7,491	101,727	2019/05/22
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,998	7,691	104,457	2021/05/25
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	5,224	5,471	74,296	2023/05/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,539	61,651	2024/03/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,495	47,475	2025/03/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,365	45,709	2026/02/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,450	2,501	33,970	2027/02/17
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金額				32,577	34,557	469,287	
					千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
スウェーデン		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	9,095	10,614	142,025	2020/12/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	8,385	8,942	119,649	2019/03/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	5,723	76,575	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	9,892	132,365	2022/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,624	102,009	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,095	5,930	79,353	2025/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,680	5,932	79,371	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,950	2,955	39,543	2028/05/12
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金額				50,850	57,615	770,894	
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.0000	21,447	20,619	124,333	2019/12/11
		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	13,290	12,099	72,959	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	4,000	4,204	25,352	2047/11/07
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	10,633	11,084	66,838	2023/12/07
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	22,119	25,601	154,377	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	10,668	10,846	65,406	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,874	8,599	51,857	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	8,844	9,655	58,221	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	22,092	22,379	134,947	2018/12/13
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	9,694	10,683	64,423	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	18,928	19,343	116,639	2020/06/11
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	27,826	27,312	164,691	2021/06/10
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	13,437	81,028	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	13,099	12,791	77,131	2022/06/09
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	15,654	16,005	96,510	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	6,944	7,142	43,068	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金額				225,127	231,806	1,397,790	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7340	647	673	18,467	2019/07/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	573	537	14,738	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.2480	738	787	21,605	2028/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	1,603	1,640	44,985	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,174	32,196	2030/04/15

外国債券インデックスマザーファンド

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	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	
					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	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	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	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

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	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	16銘柄						
	金額				31,917	32,731	1,034,302	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（アイルランド）		IRISH TREASURY	国債証券	4.4000	684	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	13銘柄						
	金額				8,727	9,950	1,321,550	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オランダ）		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	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	20銘柄						
	金額				23,054	27,284	3,623,622	

外国債券インデックスマザーファンド

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ（ベルギー）		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,453	193,015	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	26銘柄						
	金額				26,235	32,088	4,261,666	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フランス）		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	653	767	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		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	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	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,264	2,320	308,213	2019/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,787	3,322	441,301	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,799	3,112	413,332	2024/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,322	2,374	315,363	2019/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,792	2,848	378,262	2025/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,070	3,112	413,369	2020/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,101	2,217	294,528	2025/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,193	2,240	297,563	2020/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,720	2,902	385,442	2031/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,592	1,605	213,264	2019/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,737	2,763	367,059	2026/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,079	1,072	142,384	2036/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	587	572	76,097	2066/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,170	2,200	292,209	2021/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,354	312,719	2026/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,021	268,422	2022/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	620	661	87,882	2039/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	709	94,167	2020/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,602	345,661	2027/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,000	1,077	143,045	2048/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	502	66,683	2023/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	500	501	66,652	2028/05/25
国小計	銘柄数	47銘柄						
	金額				108,392	128,181	17,023,784	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ドイツ）		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,353	179,776	2024/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,567	2,481	329,605	2027/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,067	274,648	2028/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,371	182,159	2028/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,586	210,674	2030/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,336	310,273	2031/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	2,864	380,478	2034/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,071	3,191	423,903	2037/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	2,006	266,498	2039/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,399	2,463	327,114	2040/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	2,682	2,816	373,995	2019/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,481	2,650	352,009	2019/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,075	2,248	298,641	2020/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,928	2,112	280,534	2020/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,474	2,169	288,130	2042/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,444	1,560	207,198	2020/09/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,558	339,848	2021/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,903	252,760	2021/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,562	207,502	2021/09/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,807	3,089	410,342	2022/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,439	324,003	2022/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,728	2,272	301,777	2044/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,788	237,555	2022/09/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,540	204,531	2023/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,987	264,021	2023/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,798	238,889	2023/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,741	231,298	2024/02/15

外国債券インデックスマザーファンド

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	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

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	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	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（イタリア）		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	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	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	2020/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,498	3,379	448,833	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,790	3,396	451,136	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	3,088	410,175	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,734	2,380	316,198	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,745	364,647	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,708	2,873	381,613	2019/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,531	2,734	363,127	2019/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,665	353,994	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,043	2,784	369,788	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,560	2,817	374,179	2020/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,214	2,461	326,915	2020/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,552	338,975	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,399	318,623	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,667	354,278	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,404	319,339	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	2,044	271,533	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,910	2,365	314,151	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,810	2,308	306,528	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,270	301,543	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,363	1,821	241,882	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,655	352,710	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,111	2,194	291,399	2018/12/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,729	1,942	257,964	2021/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.5000	1,100	1,144	152,019	2019/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,570	341,347	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,938	2,230	296,271	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,710	227,143	2021/12/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	1.5000	1,246	1,284	170,544	2019/08/01
国小計 銘柄数	67銘柄						
国小計 金額				107,051	123,182	16,359,857	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フィンランド）	Finland Government Bond	国債証券	0.3750	432	443	58,854	2020/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	410	54,535	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	292	38,812	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	411	416	55,296	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	200	26,576	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	270	273	36,293	2022/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	298	39,664	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.3750	416	449	59,734	2019/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	857	113,846	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	3.3750	632	691	91,892	2020/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	3.5000	459	520	69,149	2021/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	476	63,246	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	612	666	88,529	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	484	64,327	2023/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	539	71,660	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	593	78,877	2024/04/15
国小計 銘柄数	16銘柄						
国小計 金額				6,863	7,614	1,011,296	
				千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ（オーストリア）	Austria Government Bond	国債証券	0.2500	527	535	71,146	2019/10/18
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	936	124,418	2025/10/20

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	926	950	126,301	2026/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	734	737	97,998	2047/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	150	131	17,529	2086/11/02
		Austria Government Bond	国債証券	—	300	301	39,980	2023/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	380	378	50,326	2027/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	170	180	23,991	2117/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	404	53,748	2022/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,280	170,103	2027/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.9000	1,248	1,394	185,142	2020/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,538	204,313	2021/09/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,073	1,637	217,465	2037/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.3500	989	1,052	139,844	2019/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,206	160,179	2026/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	936	124,393	2022/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	1,030	136,907	2022/11/22
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	318	536	71,245	2062/01/26
		Austria Government Bond	国債証券	1.9500	738	767	101,978	2019/06/18
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	870	115,608	2044/06/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,061	141,037	2023/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	621	748	99,427	2034/05/23
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,030	136,914	2024/10/21
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	当期末 比率
	千円	%
公社債	164,124,972	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。

外国債券インデックスマザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

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ＶＡ938,947,637円、ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（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５０ＶＡ（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３０ＶＡ（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５０ＶＡ（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、ＤＣ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、ＤＣ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３０　631,956,912円、ダイワ・ライフ・バランス５０　299,143,351円、ダイワ・ライフ・バランス７０　190,473,853円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）268,358,922円、ＤＣ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、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）67,378,321円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020　11,337,304円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030　17,901,368円、ＤＣ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４０ＶＡ497,823,550円、ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ166,073,932円、ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ6,394,036,947円、ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ359,421,809円、ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ142,269,988円、ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（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２５　34,455,585円、ダイワライフスタイル５０　59,697,716円、ダイワライフスタイル７５　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。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

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）

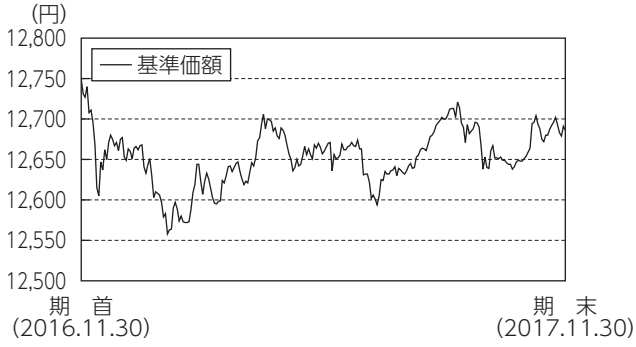
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の第13期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。）
運用方法	①主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。 ②運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債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。
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		NOMURA－BPI総合指数		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2016年11月30日	12,749	－	12,764	－	97.0	－
12月末	12,677	△0.6	12,692	△0.6	98.3	－
2017年１月末	12,606	△1.1	12,623	△1.1	99.3	－
２月末	12,644	△0.8	12,661	△0.8	99.2	－
３月末	12,626	△1.0	12,648	△0.9	99.4	－
４月末	12,689	△0.5	12,709	△0.4	99.1	－
５月末	12,665	△0.7	12,683	△0.6	98.0	－
６月末	12,631	△0.9	12,650	△0.9	99.5	－
７月末	12,634	△0.9	12,650	△0.9	99.0	－
８月末	12,700	△0.4	12,718	△0.4	99.2	－
９月末	12,653	△0.8	12,674	△0.7	99.2	－
10月末	12,654	△0.7	12,674	△0.7	99.3	－
(期末)2017年11月30日	12,686	△0.5	12,707	△0.4	99.1	－

（注１）騰落率は期首比。
（注２）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩは、野村證券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。
ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。
（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：12,749円　期末：12,686円　騰落率：△0.5％

【基準価額の主な変動要因】

金利の上昇により債券価格が下落したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内債券市況

国内債券市場は、期首より米国の利上げ観測などから海外の金利が上昇し、国内の長期金利も上昇しました。その後、長期金利はおおむねレンジ内で推移しましたが、2017年４月には、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、国内の長期金利は低下しました。５月以降は、フランス大統領選挙の結果を受けて欧州の政治リスクへの懸念が後退したことなどから、海外の金利の上昇に連れて、国内の金利も上昇しました。７月以降は、北朝鮮の地政学リスクの高まりを受けたリスク回避姿勢が再び強まったことなどから金利は低下しました。その後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海外の金利が上昇したことを受けて、国内の金利も上昇しました。11月に入ると、日銀の金融緩和策の長期化観測などから長期金利は低下しました。

◆前期における「今後の運用方針」

ベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）との高い連動性を維持するように運用を行なってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流出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、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数に含まれる債券のうち、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

◆ポートフォリオについて

当ファンドの騰落率が、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99％前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド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、ファンドの資金流出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》

ベンチマークであるＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数との高い連動性を維持するように運用を行なってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッドへの感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流出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、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、当ファンドは現在、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数に含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■１万口当りの費用の明細

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

（注）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	3,646,325	2,846,054 （　－）
	地方債証券	309,983	405,405 （　－）
	特殊債券	408,018	405,713 （　－）
	社債券	316,372	102,062 （　－）

（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 買付 銘柄	金額	当期 売付 銘柄	金額
	千円		千円
346　10年国債 0.1% 2027/3/20	190,146	368　2年国債 0.1% 2018/9/15	173,561
345　10年国債 0.1% 2026/12/20	160,612	127　5年国債 0.1% 2021/3/20	160,588
130　5年国債 0.1% 2021/12/20	148,645	341　10年国債 0.3% 2025/12/20	146,698
322　10年国債 0.9% 2022/3/20	133,648	365　2年国債 0.1% 2018/6/15	140,406
129　5年国債 0.1% 2021/9/20	131,283	344　10年国債 0.1% 2026/9/20	132,564
347　10年国債 0.1% 2027/6/20	130,864	124　5年国債 0.1% 2020/6/20	125,975
373　2年国債 0.1% 2019/2/15	126,000	362　2年国債 0.1% 2018/3/15	124,494
371　2年国債 0.1% 2018/12/15	125,724	333　10年国債 0.6% 2024/3/20	104,863
335　10年国債 0.5% 2024/9/20	122,851	332　10年国債 0.6% 2023/12/20	104,623
32東日本旅客鉄道 2.26% 2024/3/19	115,239	340　10年国債 0.4% 2025/9/20	103,380

（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ＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	10,770,000	11,927,802	78.3	－	54.0	19.0	5.2
地方債証券	1,100,000	1,129,923	7.4	－	4.0	1.4	2.0
特殊債券（除く金融債券）	800,000	820,403	5.4	－	2.0	2.7	0.7
金融債券	100,000	99,938	0.7	－	－	0.7	－
普通社債券	1,100,000	1,124,429	7.4	－	1.4	2.7	3.3
合計	13,870,000	15,102,497	99.1	－	61.5	26.4	11.2

（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	45,000	45,122	2018/12/15
	116　5年国債	0.2000	155,000	155,582	2018/12/20
	297　10年国債	1.4000	20,000	20,326	2018/12/20
	298　10年国債	1.3000	61,000	61,930	2018/12/20
	373　2年国債	0.1000	125,000	125,397	2019/02/15
	300　10年国債	1.5000	8,000	8,170	2019/03/20
	41　20年国債	1.5000	40,000	40,855	2019/03/20
	42　20年国債	2.6000	22,000	22,782	2019/03/20
	376　2年国債	0.1000	20,000	20,076	2019/05/15
	377　2年国債	0.1000	25,000	25,101	2019/06/15
	119　5年国債	0.1000	41,000	41,158	2019/06/20
	301　10年国債	1.5000	35,000	35,892	2019/06/20
	302　10年国債	1.4000	54,000	55,293	2019/06/20
	380　2年国債	0.1000	60,000	60,283	2019/09/15
	120　5年国債	0.2000	10,000	10,062	2019/09/20
	121　5年国債	0.1000	55,000	55,246	2019/09/20
	43　20年国債	2.9000	14,000	14,768	2019/09/20
	122　5年国債	0.1000	83,000	83,416	2019/12/20
	305　10年国債	1.3000	100,000	102,962	2019/12/20
	123　5年国債	0.1000	100,000	100,563	2020/03/20
	306　10年国債	1.4000	10,000	10,353	2020/03/20
	44　20年国債	2.5000	32,000	33,941	2020/03/20
	45　20年国債	2.4000	20,000	21,167	2020/03/20
	124　5年国債	0.1000	35,000	35,214	2020/06/20
	308　10年国債	1.3000	100,000	103,661	2020/06/20
	309　10年国債	1.1000	103,000	106,244	2020/06/20
	46　20年国債	2.2000	19,000	20,134	2020/06/22
	125　5年国債	0.1000	150,000	151,030	2020/09/20
	310　10年国債	1.0000	30,000	30,950	2020/09/20
	311　10年国債	0.8000	42,000	43,095	2020/09/20
	47　20年国債	2.2000	23,000	24,504	2020/09/21
	126　5年国債	0.1000	124,000	124,890	2020/12/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

区分	銘柄	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額	当期末 償還年月日
		%	千円	千円	
	312　10年国債	1.2000	94,000	97,820	2020/12/20
	48　20年国債	2.5000	9,000	9,725	2020/12/21
	313　10年国債	1.3000	34,000	35,606	2021/03/20
	314　10年国債	1.1000	77,000	80,129	2021/03/20
	49　20年国債	2.1000	4,000	4,295	2021/03/22
	50　20年国債	1.9000	30,000	32,021	2021/03/22
	128　5年国債	0.1000	107,000	107,875	2021/06/20
	315　10年国債	1.2000	90,000	94,242	2021/06/20
	316　10年国債	1.1000	56,000	58,440	2021/06/20
	51　20年国債	2.0000	25,000	26,891	2021/06/21
	129　5年国債	0.1000	110,000	110,964	2021/09/20
	317　10年国債	1.1000	40,000	41,868	2021/09/20
	318　10年国債	1.0000	33,000	34,415	2021/09/20
	52　20年国債	2.1000	19,000	20,612	2021/09/21
	130　5年国債	0.1000	127,000	128,186	2021/12/20
	319　10年国債	1.1000	140,000	146,939	2021/12/20
	320　10年国債	1.0000	35,000	36,592	2021/12/20
	53　20年国債	2.1000	13,000	14,172	2021/12/20
	54　20年国債	2.2000	14,000	15,319	2021/12/20
	131　5年国債	0.1000	60,000	60,582	2022/03/20
	321　10年国債	1.0000	65,000	68,153	2022/03/20
	322　10年国債	0.9000	140,000	146,189	2022/03/20
	55　20年国債	2.0000	41,000	44,750	2022/03/21
	132　5年国債	0.1000	20,000	20,200	2022/06/20
	323　10年国債	0.9000	70,000	73,243	2022/06/20
	324　10年国債	0.8000	80,000	83,342	2022/06/20
	56　20年国債	2.0000	12,000	13,158	2022/06/20
	57　20年国債	1.9000	24,000	26,208	2022/06/20
	133　5年国債	0.1000	70,000	70,742	2022/09/20
	325　10年国債	0.8000	160,000	167,017	2022/09/20
	58　20年国債	1.9000	35,000	38,390	2022/09/20
	326　10年国債	0.7000	20,000	20,816	2022/12/20
	59　20年国債	1.7000	3,000	3,274	2022/12/20
	328　10年国債	0.6000	60,000	62,233	2023/03/20
	61　20年国債	1.0000	40,000	42,351	2023/03/20
	329　10年国債	0.8000	50,000	52,493	2023/06/20
	62　20年国債	0.8000	16,000	16,802	2023/06/20
	63　20年国債	1.8000	30,000	33,176	2023/06/20
	330　10年国債	0.8000	81,000	85,199	2023/09/20
	331　10年国債	0.6000	73,000	75,933	2023/09/20
	64　20年国債	1.9000	35,000	39,056	2023/09/20
	332　10年国債	0.6000	35,000	36,456	2023/12/20
	65　20年国債	1.9000	42,000	47,064	2023/12/20
	66　20年国債	1.8000	30,000	33,435	2023/12/20
	333　10年国債	0.6000	53,000	55,278	2024/03/20
	67　20年国債	1.9000	19,000	21,378	2024/03/20
	68　20年国債	2.2000	25,000	28,603	2024/03/20
	69　20年国債	2.1000	12,000	13,653	2024/03/20
	334　10年国債	0.6000	156,000	162,921	2024/06/20
	70　20年国債	2.4000	18,000	20,928	2024/06/20
	71　20年国債	2.2000	17,000	19,542	2024/06/20
	335　10年国債	0.5000	140,000	145,496	2024/09/20
	72　20年国債	2.1000	53,000	60,851	2024/09/20
	336　10年国債	0.5000	18,000	18,732	2024/12/20
	337　10年国債	0.3000	30,000	30,785	2024/12/20
	73　20年国債	2.0000	30,000	34,383	2024/12/20
	74　20年国債	2.1000	22,000	25,370	2024/12/20
	338　10年国債	0.4000	152,000	157,177	2025/03/20
	75　20年国債	2.1000	14,000	16,208	2025/03/20
	76　20年国債	1.9000	25,000	28,577	2025/03/20
	339　10年国債	0.4000	45,000	46,532	2025/06/20
	78　20年国債	1.9000	17,000	19,502	2025/06/20
	79　20年国債	2.0000	14,000	16,166	2025/06/20
	80　20年国債	2.1000	20,000	23,246	2025/06/20
	340　10年国債	0.4000	55,000	56,892	2025/09/20
	81　20年国債	2.0000	39,000	45,202	2025/09/20
	82　20年国債	2.1000	28,000	32,672	2025/09/20
	341　10年国債	0.3000	15,000	15,399	2025/12/20
	83　20年国債	2.1000	25,000	29,281	2025/12/20
	84　20年国債	2.0000	27,000	31,406	2025/12/20
	342　10年国債	0.1000	40,000	40,415	2026/03/20
	85　20年国債	2.1000	31,000	36,442	2026/03/20
	86　20年国債	2.3000	6,000	7,152	2026/03/20
	87　20年国債	2.2000	20,000	23,677	2026/03/20
	343　10年国債	0.1000	152,000	153,494	2026/06/20
	88　20年国債	2.3000	33,000	39,517	2026/06/20
	89　20年国債	2.2000	15,000	17,834	2026/06/20
	344　10年国債	0.1000	48,000	48,443	2026/09/20
	90　20年国債	2.2000	37,000	44,158	2026/09/20
	91　20年国債	2.3000	12,000	14,427	2026/09/20
	345　10年国債	0.1000	150,000	151,287	2026/12/20
	92　20年国債	2.1000	45,000	53,473	2026/12/20
	346　10年国債	0.1000	143,000	144,126	2027/03/20
	93　20年国債	2.0000	18,000	21,304	2027/03/20
	94　20年国債	2.1000	45,000	53,679	2027/03/20
	347　10年国債	0.1000	130,000	130,989	2027/06/20
	95　20年国債	2.3000	30,000	36,479	2027/06/20
	96　20年国債	2.1000	23,000	27,530	2027/06/20
	348　10年国債	0.1000	80,000	80,546	2027/09/20
	97　20年国債	2.2000	25,000	30,283	2027/09/20
	98　20年国債	2.1000	34,000	40,853	2027/09/20
	99　20年国債	2.1000	53,000	63,921	2027/12/20
	100　20年国債	2.2000	35,000	42,703	2028/03/20
	101　20年国債	2.4000	18,000	22,330	2028/03/20
	102　20年国債	2.4000	10,000	12,444	2028/06/20
	103　20年国債	2.3000	21,000	25,914	2028/06/20
	104　20年国債	2.1000	34,000	41,244	2028/06/20
	105　20年国債	2.1000	38,000	46,239	2028/09/20
	106　20年国債	2.2000	16,000	19,640	2028/09/20
	107　20年国債	2.1000	20,000	24,409	2028/12/20
	108　20年国債	1.9000	48,000	57,500	2028/12/20
	109　20年国債	1.9000	35,000	42,056	2029/03/20
	110　20年国債	2.1000	27,000	33,047	2029/03/20
	111　20年国債	2.2000	35,000	43,361	2029/06/20
	112　20年国債	2.1000	29,000	35,597	2029/06/20
	113　20年国債	2.1000	64,000	78,737	2029/09/20

区分	銘柄	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額	当期末 償還年月日
		%	千円	千円	
	114 20年国債	2.1000	45,000	55,512	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	22,000	27,400	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	9,000	11,449	2030/02/20
	116 20年国債	2.2000	27,000	33,720	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	37,000	45,761	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	4,000	5,051	2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	13,000	15,950	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	13,000	15,621	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	60,000	70,623	2030/06/20
	121 20年国債	1.9000	56,000	68,131	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	10,000	12,041	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	8,000	10,769	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	42,000	52,276	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	45,000	55,437	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	25,000	31,513	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	21,000	25,910	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	23,000	28,080	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	8,000	10,103	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	32,000	39,146	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	34,000	41,145	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	28,000	33,945	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	27,000	32,349	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	9,000	11,657	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	25,000	29,999	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	47,000	57,038	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	15,000	18,232	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	20,000	24,017	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	40,000	47,483	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	12,000	15,453	2032/05/20
	137 20年国債	1.7000	18,000	21,647	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	24,000	28,170	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	32,000	38,035	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	60,000	72,257	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	5,000	6,100	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	11,000	12,778	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	48,000	57,839	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	30,000	36,609	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	15,000	16,754	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	48,000	57,205	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	24,000	28,230	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	9,000	10,871	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	65,000	78,455	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	11,000	13,964	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	58,000	70,086	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	11,000	13,809	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	74,000	88,319	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	22,000	29,040	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	59,000	69,510	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	21,000	28,104	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	67,000	78,924	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	26,000	34,839	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	46,000	53,449	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	17,000	22,550	2034/12/20

区分	銘柄	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額	当期末 償還年月日
		%	千円	千円	
	151 20年国債	1.2000	64,000	72,226	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	20,000	26,208	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	69,000	77,800	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	15,000	19,687	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	72,000	82,352	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	16,000	21,563	2035/09/20
	154 20年国債	1.2000	67,000	75,464	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	16,000	21,045	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	59,000	64,361	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	17,000	22,986	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	63,000	62,048	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	16,000	21,650	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	77,000	72,894	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	15,000	20,328	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	63,000	62,837	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	17,000	22,437	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	60,000	60,778	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	32,000	42,847	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	54,000	55,557	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	69,000	69,547	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	32,000	43,566	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	30,000	30,186	2037/09/20
	28 30年国債	2.5000	34,000	46,440	2038/03/20
	29 30年国債	2.4000	43,000	58,060	2038/09/20
	30 30年国債	2.3000	37,000	49,387	2039/03/20
	31 30年国債	2.2000	38,000	50,104	2039/09/20
	32 30年国債	2.3000	49,000	65,765	2040/03/20
	33 30年国債	2.0000	55,000	70,510	2040/09/20
	34 30年国債	2.2000	50,000	66,347	2041/03/20
	35 30年国債	2.0000	56,000	72,023	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	59,000	76,027	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	57,000	72,290	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	39,000	48,635	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	37,000	47,028	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	29,000	36,207	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	29,000	35,544	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	33,000	40,461	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	37,000	45,383	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	35,000	42,945	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	28,000	33,018	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	40,000	47,224	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	44,000	53,021	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	45,000	51,966	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	45,000	51,957	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	44,000	44,050	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	45,000	39,269	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	47,000	43,344	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	40,000	37,891	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	45,000	44,840	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	32,000	31,885	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	30,000	29,856	2047/09/20
	1 40年国債	2.4000	60,000	85,171	2048/03/20
	2 40年国債	2.2000	23,000	31,531	2049/03/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

区分		当期末 銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
			%	千円	千円	
		3　40年国債	2.2000	19,000	26,161	2050/03/20
		4　40年国債	2.2000	30,000	41,422	2051/03/20
		5　40年国債	2.0000	35,000	46,363	2052/03/20
		6　40年国債	1.9000	28,000	36,326	2053/03/20
		7　40年国債	1.7000	31,000	38,361	2054/03/20
		8　40年国債	1.4000	23,000	26,284	2055/03/20
		9　40年国債	0.4000	20,000	16,404	2056/03/20
		10　40年国債	0.9000	19,000	18,490	2057/03/20
種別小計	銘柄数	252銘柄				
	金額			10,770,000	11,927,802	
地方債証券		21-2　埼玉県公債	1.5700	100,000	102,280	2019/05/27
		76　共同発行地方	1.4000	100,000	102,250	2019/07/25
		21-6　大阪市公債	1.5700	100,000	103,044	2019/11/25
		21-35　兵庫県公債	1.4600	100,000	103,041	2020/01/22
		116　共同発行地方	0.8000	100,000	103,739	2022/11/25
		117　共同発行地方	0.7200	100,000	103,391	2022/12/22
		24-16　愛知県公債	0.7570	100,000	103,633	2023/01/31
		25-6　大阪市公債	0.6940	100,000	103,656	2023/11/22
		3　兵庫県公債12年	0.5600	100,000	103,304	2025/04/16
		751　東京都公債	0.3700	100,000	102,001	2025/12/19
		28-1　静岡県公債	0.0800	100,000	99,580	2026/03/19
種別小計	銘柄数	11銘柄				
	金額			1,100,000	1,129,923	
特殊債券（除く金融債券）		5　日本政策投資ＣＯ	1.7450	100,000	102,209	2019/03/20
		98　政保道路機構	1.3000	100,000	102,791	2020/01/31
		14　政保地方公共6	0.1990	100,000	100,468	2020/06/18
		122　政保道路機構	0.9000	100,000	102,638	2020/11/30
		36　地方公共団体	0.8920	100,000	103,740	2022/05/27
		190　政保道路機構	0.6050	100,000	103,191	2023/05/31
		65　地方公共団体	0.5350	100,000	102,941	2024/10/28
		261　政保道路機構	0.3810	100,000	102,423	2025/11/28
種別小計	銘柄数	8銘柄				
	金額			800,000	820,403	
金融債券		い789　利付商工債	0.0500	100,000	99,938	2021/02/26
種別小計	銘柄数	1銘柄				
	金額			100,000	99,938	
普通社債券		35　みずほＢＫ	0.2850	100,000	100,306	2019/01/25
		25　東日本高速道	0.2990	100,000	100,323	2019/03/20
		27　東日本高速道	0.2480	100,000	100,304	2019/06/20
		1　明治安田2014基	0.5100	100,000	100,384	2019/08/07
		164　オリックス	1.1460	100,000	101,821	2019/08/07
		62　トヨタファイナンス	0.2030	100,000	100,320	2019/12/20
		70　東日本旅客鉄道	1.1930	100,000	103,177	2020/09/29
		44　野村ホールディング	0.7230	100,000	101,656	2021/02/25
		33　中日本高速道	1.0840	100,000	103,730	2021/09/17
		32　東日本旅客鉄道	2.2600	100,000	113,278	2024/03/19
		20　成田国際空港	0.1050	100,000	99,126	2026/08/21
種別小計	銘柄数	11銘柄				
	金額			1,100,000	1,124,429	
合計	銘柄数	283銘柄				
	金額			13,870,000	15,102,497	

（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	%
公社債	15,102,497	98.4
コール・ローン等、その他	246,647	1.6
投資信託財産総額	15,349,145	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	**15,349,145,391円**
コール・ローン等	202,868,446
公社債(評価額)	15,102,497,620
未収利息	43,431,530
前払費用	347,795
(B) 負債	**114,185,400**
未払金	85,472,200
未払解約金	28,713,200
(C) 純資産総額(A－B)	**15,234,959,991**
元本	12,009,349,541
次期繰越損益金	3,225,610,450
(D) 受益権総口数	**12,009,349,541口**
1万口当り基準価額(C／D)	**12,686円**

＊期首における元本額は11,657,959,812円、当期中における追加設定元本額は2,879,778,134円、同解約元本額は2,528,388,405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、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050　50,696円、iFree 日本債券インデックス94,668,076円、iFree 8資産バランス543,440,765円、ダイワ・ライフ・バランス３０　5,130,322,238円、ダイワ・ライフ・バランス５０　2,649,585,248円、ダイワ・ライフ・バランス７０　843,580,898円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）594,643,613円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）481,759,356円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）149,218,958円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020　62,568,809円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030　46,834,137円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040　3,426,895円、ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ779,481,047円、ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ220,899,817円、ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ199,599,698円、ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ209,269,290円です。

＊当期末の計算口数当りの純資産額は12,686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	**157,318,284円**
受取利息	157,374,353
支払利息	△ 56,069
(B) 有価証券売買損益	**△ 228,882,740**
売買益	7,261,770
売買損	△ 236,144,510
(C) その他費用	**△ 412**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**△ 71,564,868**
(E) 前期繰越損益金	**3,205,000,337**
(F) 解約差損益金	**△ 672,635,976**
(G) 追加信託差損益金	**764,810,957**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**3,225,610,450**
次期繰越損益金(H)	**3,225,610,450**

（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・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

運用報告書　第25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）

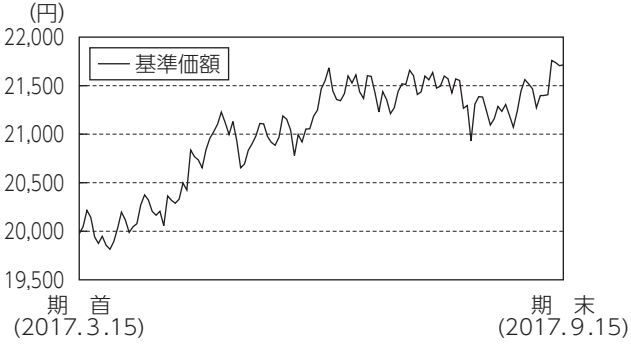
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの第25期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。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（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）
運用方法	①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を主要投資対象とし、安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして分散投資を行ないます。 ②投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。 イ．個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。 ロ．組み入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。 ③外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。 ④不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態で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。 ⑤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（除く日本、円換算）		投資信託証券組入比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率	
	円	%		%	%
(期首)2017年3月15日	19,973	−	20,890	−	96.5
3月末	20,197	1.1	21,070	0.9	96.3
4月末	20,735	3.8	21,388	2.4	96.3
5月末	20,886	4.6	21,085	0.9	96.9
6月末	21,435	7.3	21,741	4.1	96.9
7月末	21,475	7.5	21,725	4.0	97.7
8月末	21,444	7.4	21,581	3.3	97.4
(期末)2017年9月15日	21,714	8.7	21,965	5.1	96.9

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、円換算）は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、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。Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、米ドルベース）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。

《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：19,973円　期末：21,714円　騰落率：8.7%

【基準価額の主な変動要因】

米国の長期金利の低下などを背景に海外リート市況が上昇したことや、米ドルを除く主要通貨が対円でおおむね上昇（円安）したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は上昇しました。

米国では、北朝鮮情勢の緊迫化など地政学的リスクの高まりから軟調に推移する局面もありましたが、市場予想を下回る経済指標の発表が相次いだことなどから長期金利が低下し、リートの利回り資産としての魅力が高まったことを背景に、堅調な相場展開となりました。

欧州では、英国は、中国を中心としたアジアからの不動産投資需要が旺盛との見方などを受けて上昇したほか、ユーロ圏でも、フランス大統領選挙で親ＥＵ（欧州連合）派のマクロン氏が勝利し当面の政治リスクへの懸念が後退したことや域内の景気回復期待を背景に、ほぼ全面高となる展開でした。

アジア・オセアニアでは、香港市場の値上がりが相対的に大きくなりました。大手オフィスリートが主要保有物件の一部を売却する可能性を示唆したことから投資家への還元期待が膨らんだことが、支援材料となりました。

○為替相場

為替相場は、米ドルについては、米国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から対円で下落（円高）したものの、ユーロなどその他の主要通貨については、各国の中央銀行が金融緩和姿勢を後退させる中で内外金利差が拡大傾向となったことなどから対円で上昇（円安）するなど、まちまちの展開となりました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

当ファンドでは、信託財産の中長期的な成長をめざし保有不動産の価値などと比べて魅力的であると考える銘柄に着目するとともに、安定的な配当利回りの確保をめざしてポートフォリオを構築しました。

国・地域別配分では、大きなリスクを取らず各地域にバランス良く投資を行ないました。米国では、好調な労働市場から恩恵を受けるとみられる住宅セクターなどに注目しました。欧州では、ロンドンからの代替需要が期待される域内主要都市のオフィスを保有するリートおよび英国の産業施設リートに、アジア・オセアニアでは、シドニーの良好なオフィス需給から恩恵を受けるオーストラリアのオフィスリートなどに注目しました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

《今後の運用方針》

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

■１万口当りの費用の明細

項　目	当　期
売買委託手数料	12円
（投資信託証券）	（ 12）
有価証券取引税	5
（投資信託証券）	（ 5）
その他費用	△ 7
（保管費用）	（ 4）
（その他）	（△11）
合　計	10

（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
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	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口 4,803.412 （ 125.319）	千アメリカ・ドル 190,623 （ －）	千口 5,945.213 （ －）	千アメリカ・ドル 213,362 （ －）
	オーストラリア	千口 11,911.657 （ －）	千オーストラリア・ドル 54,643 （ －）	千口 19,649.518 （ －）	千オーストラリア・ドル 68,290 （ －）
	香港	千口 － （ －）	千香港ドル － （ －）	千口 4,398.876 （ －）	千香港ドル 27,711 （ －）
外国	シンガポール	千口 7,210.1 （ －）	千シンガポール・ドル 18,807 （△ 82）	千口 18,354.8 （ －）	千シンガポール・ドル 33,290 （ －）
	イギリス	千口 8,538.526 （ 788.878）	千イギリス・ポンド 28,585 （ 5,359）	千口 10,503.77 （ －）	千イギリス・ポンド 30,214 （ －）
	ユーロ（オランダ）	千口 164.034 （ －）	千ユーロ 5,951 （ －）	千口 － （ －）	千ユーロ － （ －）
	ユーロ（ベルギー）	千口 87.941 （ 11.779）	千ユーロ 6,397 （ 763）	千口 15.053 （ －）	千ユーロ 1,175 （ －）
	ユーロ（フランス）	千口 122.164 （ 26.34）	千ユーロ 11,002 （ 2,910）	千口 1,526.798 （ －）	千ユーロ 62,445 （ －）
	ユーロ（ドイツ）	千口 56.761 （ －）	千ユーロ 704 （△ 1,035）	千口 672.683 （ －）	千ユーロ 8,317 （ －）
	ユーロ（スペイン）	千口 1,570.762 （ －）	千ユーロ 17,550 （△ 146）	千口 472.821 （ －）	千ユーロ 6,821 （ －）
	ユーロ（ユーロ　通貨計）	千口 2,001.662 （ 38.119）	千ユーロ 41,607 （ 2,492）	千口 2,687.355 （ －）	千ユーロ 78,760 （ －）

（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
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				当期 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
EQUITY RESIDENTIAL（アメリカ）	298.427	2,231,607	7,477	KLEPIERRE（フランス）	1,470.945	6,558,460	4,458
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA（スペイン）	1,570.762	2,223,743	1,415	VICINITY CENTRES（オーストラリア）	12,629.696	2,967,402	234
GOODMAN GROUP（オーストラリア）	3,363.116	2,209,311	656	AVALONBAY COMMUNITIES INC（アメリカ）	123.917	2,544,925	20,537
HCP INC（アメリカ）	492.903	1,708,660	3,466	SCENTRE GROUP（オーストラリア）	5,615.324	2,006,241	357
DUKE REALTY CORP（アメリカ）	554.136	1,643,260	2,965	HOST HOTELS & RESORTS INC（アメリカ）	896.057	1,798,655	2,007
APARTMENT INVT & MGMT CO -A（アメリカ）	268.099	1,333,443	4,973	BIG YELLOW GROUP PLC（イギリス）	1,516.634	1,714,229	1,130
REGENCY CENTERS CORP（アメリカ）	187.895	1,287,821	6,853	PROLOGIS INC（アメリカ）	258.557	1,564,869	6,052
SIMON PROPERTY GROUP INC（アメリカ）	67.279	1,185,070	17,614	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC（アメリカ）	714.094	1,505,655	2,108
PHYSICIANS REALTY TRUST（アメリカ）	544.308	1,160,803	2,132	APARTMENT INVT & MGMT CO -A（アメリカ）	285.388	1,404,308	4,920
FONCIERE DES REGIONS（フランス）	103.351	1,127,219	10,906	PUBLIC STORAGE（アメリカ）	59.265	1,378,451	23,259

（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

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	
不動産ファンド				
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	336.194	11,497	1,267,176	1.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC	53.461	9,822	1,082,525	1.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	213.685	34,990	3,856,349	3.4
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	268.099	12,268	1,352,079	1.2
GGP INC	224.623	4,874	537,198	0.5
VORNADO REALTY TRUST	162.894	12,246	1,349,672	1.2
EQUITY RESIDENTIAL	298.427	20,110	2,216,432	2.0
APPLE HOSPITALITY REIT INC	416.932	7,813	861,104	0.8
EPR PROPERTIES	141.74	10,188	1,122,849	1.0
EQUINIX INC	17.691	8,047	886,949	0.8
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	288.006	7,266	800,828	0.7
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	245.956	5,383	593,368	0.5
GRAMERCY PROPERTY TRUST	249.185	7,632	841,181	0.7
RLJ LODGING TRUST	254.097	5,470	602,926	0.5
PHYSICIANS REALTY TRUST	930.695	17,283	1,904,760	1.7
CYRUSONE INC	106.284	6,547	721,555	0.6
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	202.641	7,617	839,499	0.7
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	445.431	9,122	1,005,382	0.9
VENTAS INC	153.54	10,585	1,166,578	1.0
GEO GROUP INC/THE	302.267	7,928	873,795	0.8
CROWN CASTLE INTL CORP	189.542	19,865	2,189,420	1.9
SUN COMMUNITIES INC	215.149	19,186	2,114,597	1.9
PROLOGIS INC	172.133	11,238	1,238,602	1.1
COUSINS PROPERTIES INC	1,100.283	10,166	1,120,462	1.0
DUKE REALTY CORP	359.46	10,675	1,176,597	1.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC	96.617	25,329	2,791,521	2.5
FEDERAL REALTY INVS TRUST	100.25	13,129	1,447,028	1.3
HCP INC	492.903	14,530	1,601,437	1.4
KILROY REALTY CORP	143.191	10,023	1,104,675	1.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	295.778	9,719	1,071,160	0.9
REGENCY CENTERS CORP	187.895	12,301	1,355,746	1.2
SL GREEN REALTY CORP	120.466	11,786	1,298,978	1.1
UDR INC	737.671	28,732	3,166,585	2.8
CUBESMART	261.07	6,779	747,222	0.7
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	462.469	7,311	805,815	0.7
DIGITAL REALTY TRUST INC	227.586	27,521	3,033,196	2.7
EXTRA SPACE STORAGE INC	131.788	10,328	1,138,273	1.0
EDUCATION REALTY TRUST INC	390.32	15,366	1,693,585	1.5
DOUGLAS EMMETT INC	323.563	12,670	1,396,440	1.2
アメリカ・ドル通貨計 口数、金額	11,319.982	493,363	54,373,565	
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	39銘柄			<48.0%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	501.527	19,098	1,728,000	1.5
カナダ・ドル通貨計 口数、金額	501.527	19,098	1,728,000	
カナダ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	1銘柄			< 1.5%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
NATIONAL STORAGE REIT	13,294.696	20,207	1,779,915	1.6
SCENTRE GROUP	3,690.845	14,911	1,313,362	1.2
DEXUS	5,074.082	47,696	4,201,096	3.7
INVESTA OFFICE FUND	4,389.327	19,708	1,735,887	1.5
MIRVAC GROUP	10,367.637	23,845	2,100,317	1.9
GOODMAN GROUP	5,832.909	48,296	4,253,954	3.8
CHARTER HALL GROUP	1,992.634	11,497	1,012,699	0.9
INGENIA COMMUNITIES GROUP	7,640.529	19,406	1,709,363	1.5
オーストラリア・ドル通貨計 口数、金額	52,282.659	205,569	18,106,596	
オーストラリア・ドル通貨計 銘柄数<比率>	8銘柄			<16.0%>

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	
(香港)	千口	千香港ドル	千円	%
FORTUNE REIT	14,679.07	136,074	1,920,017	1.7
LINK REIT	2,834.42	181,544	2,561,594	2.3
香港ドル通貨計 口数、金額	17,513.49	317,619	4,481,612	
香港ドル通貨計 銘柄数<比率>	2銘柄			< 4.0%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	15,484.213	20,206	1,653,126	1.5
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	3,027.6	8,174	668,757	0.6
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	4,182.5	11,167	913,594	0.8
シンガポール・ドル通貨計 口数、金額	22,694.313	39,548	3,235,478	
シンガポール・ドル通貨計 銘柄数<比率>	3銘柄			< 2.9%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	16,235.277	10,098	1,490,212	1.3
CAPITAL & REGIONAL PLC	7,233.124	4,086	603,076	0.5
SEGRO PLC	5,587.351	29,724	4,386,475	3.9
UNITE GROUP PLC	980.069	6,556	967,566	0.9
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	750.187	4,512	665,891	0.6
DERWENT LONDON PLC	180.328	4,971	733,665	0.6
WORKSPACE GROUP PLC	474.456	4,198	619,636	0.5
SAFESTORE HOLDINGS PLC	1,127.069	4,564	673,602	0.6
BIG YELLOW GROUP PLC	999.841	7,578	1,118,402	1.0
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	4,414.183	7,376	1,088,491	1.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	5,276.931	7,598	1,121,352	1.0
イギリス・ポンド通貨計 口数、金額	43,258.816	91,267	13,468,372	
イギリス・ポンド通貨計 銘柄数<比率>	11銘柄			<11.9%>
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千円	%
EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	164.034	5,894	773,838	0.7
国小計 口数、金額	164.034	5,894	773,838	
国小計 銘柄数<比率>	1銘柄			< 0.7%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千円	%
AEDIFICA	70.32	5,621	737,974	0.7
WAREHOUSES DE PAUW SCA	70.73	6,641	871,902	0.8
国小計 口数、金額	141.05	12,262	1,609,877	
国小計 銘柄数<比率>	2銘柄			< 1.4%>
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円	%
GECINA SA	210.72	28,099	3,688,903	3.3
FONCIERE DES REGIONS	103.351	8,622	1,131,971	1.0
国小計 口数、金額	314.071	36,722	4,820,875	
国小計 銘柄数<比率>	2銘柄			< 4.3%>
ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,517.516	18,498	2,428,485	2.1
国小計 口数、金額	1,517.516	18,498	2,428,485	
国小計 銘柄数<比率>	1銘柄			< 2.1%>
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千円	%
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	165.006	2,552	335,110	0.3
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	2,934.96	34,485	4,527,293	4.0
国小計 口数、金額	3,099.966	37,038	4,862,404	
国小計 銘柄数<比率>	2銘柄			< 4.3%>
ユーロ通貨計 口数、金額	5,236.637	110,416	14,495,480	
ユーロ通貨計 銘柄数<比率>	8銘柄			<12.8%>
合計 口数、金額	152,807.424	－	109,889,105	
合計 銘柄数<比率>	72銘柄			<96.9%>

(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。

■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	109,889,105	96.7
コール・ローン等、その他	3,736,129	3.3
投資信託財産総額	113,625,235	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、９月15日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝110.21円、１カナダ・ドル＝90.48円、１オーストラリア・ドル＝88.08円、１香港ドル＝14.11円、１シンガポール・ドル＝81.81円、１イギリス・ポンド＝147.57円、１ユーロ＝131.28円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（112,674,007千円）の投資信託財産総額（113,625,235千円）に対する比率は、99.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年９月15日現在

項目	当期末
(A) 資産	**113,668,833,372円**
コール・ローン等	2,972,985,549
投資信託証券(評価額)	109,889,105,689
未収入金	633,458,415
未収配当金	173,283,719
(B) 負債	**314,965,595**
未払金	171,009,595
未払解約金	143,956,000
(C) 純資産総額(A－B)	**113,353,867,777**
元本	52,202,476,521
次期繰越損益金	61,151,391,256
(D) 受益権総口数	**52,202,476,521口**
１万口当り基準価額(C／D)	**21,714円**

＊期首における元本額は57,888,284,111円、当期中における追加設定元本額は192,103,611円、同解約元本額は5,877,911,201円です。
＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・オープン（毎月分配型）47,238,803,685円、ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）41,576,821円、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）24,036,421円、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）23,098,279円、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）113,237,965円、６資産バランスファンド（分配型）197,720,624円、６資産バランスファンド（成長型）409,284,512円、りそな　ワールド・リート・ファンド2,071,033,968円、世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）61,875,964円、『しがぎん』ＳＲＩ三資産バランス・オープン（奇数月分配型）5,657,671円、常陽３分法ファンド306,660,958円、ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）71,655,585円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）202,573,938円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）275,356,861円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）329,883,383円、ダイワ・グローバルＲＥＩＴファンド（ダイワＳＭＡ専用）163,901,312円、ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（分配型）598,962,009円、ダイワ外国３資産バランス・ファンド（部分為替ヘッジあり）29,254,535円、ダイワ外国３資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）37,902,030円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は21,714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	**2,295,206,214円**
受取配当金	2,289,118,056
受取利息	590,728
その他収益金	6,078,469
支払利息	△ 581,039
(B) 有価証券売買損益	**7,305,978,412**
売買益	11,641,228,901
売買損	△ 4,335,250,489
(C) その他費用	**41,079,331**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**9,642,263,957**
(E) 前期繰越損益金	**57,731,205,192**
(F) 解約差損益金	**△ 6,439,334,282**
(G) 追加信託差損益金	**217,256,389**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**61,151,391,256**
次期繰越損益金(H)	**61,151,391,256**

（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Ｊ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

運用報告書　第24期（決算日　2017年11月10日）

（計算期間　2017年５月11日～2017年11月10日）

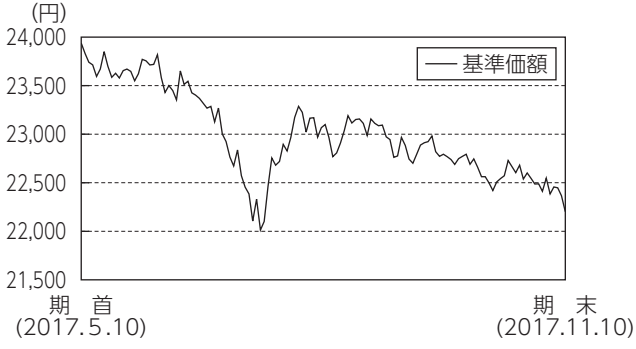
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの第24期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。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。）
運用方法	①わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。 ②投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。 イ．個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。 ロ．個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。 ③不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態で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。
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
		騰落率	(参考指数)	騰落率	
	円	%		%	%
(期首)2017年５月10日	23,938	－	3,311.95	－	97.6
５月末	23,622	△1.3	3,271.22	△1.2	97.5
６月末	23,002	△3.9	3,180.48	△4.0	97.5
７月末	23,287	△2.7	3,220.02	△2.8	97.1
８月末	23,094	△3.5	3,188.63	△3.7	95.9
９月末	22,748	△5.0	3,139.87	△5.2	97.8
10月末	22,489	△6.1	3,099.44	△6.4	97.7
(期末)2017年11月10日	22,201	△7.3	3,055.50	△7.7	96.1

（注）騰落率は期首比。

《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：23,938円　期末：22,201円　騰落率：△7.3%

【基準価額の主な変動要因】

海外の金利上昇懸念や投資信託からの資金流出を背景にＪリート市況が下落したため、基準価額も下落しました。

◆投資環境について

○Ｊリート（不動産投信）市況

Ｊリート市況は、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たこと、また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、Ｊ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、北朝鮮の核開発に関する地政学リスクが高まったことや米国の長期金利上昇、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」

個別銘柄ごとの流動性を勘案しつつＪリートに幅広く分散投資を行ない、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。国内外の景況感や金利動向に加えて、地政学リスクなど外部環境の先行き不透明感が強いため、成長戦略やバリュエーションなどを切り口に個別銘柄ごとの選別を重視した運用を進めていく方針です。

◆ポートフォリオについて

リートの組入比率につきましては、通常の状態で信託財産の純資産総額の80％程度以上に維持することを基本としており、おおむね95～98％台程度で推移させました。銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資しました。個別銘柄では、期を通じてみると、森ヒルズリート、ケネディクス・オフィス、大江戸温泉リートなどを東証ＲＥＩＴ指数と比較してオーバーウエートとし、ユナイテッド・アーバン、日本リテールファンド、日本プライムリアルティ等をアンダーウエートとしました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当ファンドは、参考指数として東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）を用いています。当期における東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の騰落率は△7.7％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△7.3％となりました。

投資口価格のパフォーマンスが東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）を上回ったＯｎｅリート、大江戸温泉リート、日本リートなどをオーバーウエートとしていたことや、投資口価格のパフォーマンスが東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）を下回った日本プライムリアルティや日本ロジスティクスファンドのアンダーウエートが、プラスに寄与しました。他方、投資口価格のパフォーマンスが東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）を上回ったさくら総合リートをアンダーウエートとしていたことや、投資口価格のパフォーマンスが東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）を下回ったＡＰＩのオーバーウエートなどが、マイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

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

■１万口当りの費用の明細

項　目	当　期
売買委託手数料	5円
（投資信託証券）	(5)
有価証券取引税	－
その他費用	－
合　計	5

（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
投資信託証券

（2017年５月11日から2017年11月10日まで）

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
国内	89.13	14,594,202	16.876 (　－)	4,440,364 (　－)

（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。

■主要な売買銘柄
投資信託証券

（2017年５月11日から2017年11月10日まで）

当期 買付 銘柄	口数	金額	平均単価	当期 売付 銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
日本ビルファンド	4.32	2,514,653	582,095	日本ロジスティクスファンド投資法人	4.9	1,081,582	220,731
野村不動産マスターF	7.392	1,080,656	146,192	ジャパンリアルエステイト	1.31	699,285	533,805
森トラスト総合リート	5.132	946,005	184,334	産業ファンド	1.214	583,579	480,708
日本リート投資法人	3.074	921,855	299,887	グローバル・ワン不動産投資法人	1.527	569,726	373,101
インヴィンシブル投資法人	14.735	668,309	45,355	フロンティア不動産投資	0.75	349,251	465,668
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8.871	658,363	74,215	プレミア投資法人	3	330,603	110,201
ジャパンリアルエステイト	1	576,516	576,516	大和ハウスリート投資法人	1.225	325,734	265,905
ラサールロジポート投資	5.107	556,209	108,911	ケネディクス商業リート	1	238,138	238,138
三菱地所物流ＲＥＩＴ	1.985	555,600	279,899	大和証券オフィス投資法人	0.2	111,875	559,375
ジャパンエクセレント投資法人	4.177	543,761	130,179	阪急リート投資法人	0.75	102,271	136,362

（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邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当期末 口数	当期末 評価額	当期末 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	3.044	1,330,228	1.6
ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	2.044	744,016	0.9
森ヒルズリート	20.294	2,662,572	3.1
産業ファンド	2.786	1,292,704	1.5
アドバンス・レジデンス	8.118	2,135,034	2.5
ケネディクスレジデンシャル	4.059	1,171,021	1.4
ＡＰＩ投資法人	6.088	2,703,072	3.2
ＧＬＰ投資法人	20	2,230,000	2.6
コンフォリア・レジデンシャル	6.088	1,400,240	1.6
日本プロロジスリート	15.221	3,543,448	4.1
星野リゾート・リート	1.015	551,145	0.6
Ｏｎｅリート投資法人	4.059	921,393	1.1
イオンリート投資	17.25	1,957,875	2.3

ファンド名	当期末 口数	当期末 評価額	当期末 比率
	千口	千円	%
ヒューリックリート投資法	9.763	1,541,577	1.8
日本リート投資法人	5.074	1,654,124	1.9
インベスコ・オフィス・Ｊリート	10.022	1,073,356	1.3
積水ハウス・リート投資	10.147	1,255,183	1.5
ケネディクス商業リート	6.515	1,473,693	1.7
ヘルスケア&メディカル投資	1.589	162,395	0.2
ジャパン・シニアリビング	1.05	144,900	0.2
野村不動産マスターＦ	34.392	4,735,778	5.5
ラサールロジポート投資	12.107	1,316,030	1.5
三井不ロジパーク	1.142	369,437	0.4
大江戸温泉リート	9.7	882,700	1.0
投資法人みらい	5.074	841,776	1.0
三菱地所物流ＲＥＩＴ	1.985	544,485	0.6

ファンド名		当期末		
		口数	評価額	比率
		千口	千円	%
日本ビルファンド		12.82	6,871,520	8.0
ジャパンリアルエステイト		9.19	4,769,610	5.6
日本リテールファンド		15	2,986,500	3.5
オリックス不動産投資		20.294	3,111,070	3.6
日本プライムリアルティ		4.059	1,459,210	1.7
プレミア投資法人		6.088	605,147	0.7
グローバル・ワン不動産投資法人		1.517	556,739	0.6
ユナイテッド・アーバン投資法人		16.235	2,597,600	3.0
森トラスト総合リート		9.132	1,456,554	1.7
インヴィンシブル投資法人		29.735	1,385,651	1.6
フロンティア不動産投資		3.298	1,449,471	1.7
平和不動産リート		8.118	739,549	0.9
福岡リート投資法人		7.103	1,125,825	1.3
ケネディクス・オフィス投資法人		4.751	2,803,090	3.3
積水ハウス・レジデンシャル投資法人		10	1,083,000	1.3
いちごオフィスリート投資法人		10.147	762,039	0.9
大和証券オフィス投資法人		2.35	1,287,800	1.5
阪急リート投資法人		1.268	166,108	0.2
スターツプロシード投資法人		1.241	201,290	0.2
大和ハウスリート投資法人		9.937	2,564,739	3.0
ジャパン・ホテル・リート投資法人		38.871	2,919,212	3.4
日本賃貸住宅投資法人		16.597	1,299,545	1.5
ジャパンエクセレント投資法人		12.177	1,590,316	1.9
合計	口数、金額	468.554	82,429,778	
	銘柄数<比率>	49銘柄		<96.1%>

※産業ファンド、ＡＰＩ投資法人、ＧＬＰ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、積水ハウス・リート投資、ケネディクス商業リート、三菱地所物流ＲＥＩＴ、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、いちごオフィスリート投資法人、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項に規定されてい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）比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
（注２）評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月10日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託証券	82,429,778	95.9
コール・ローン等、その他	3,521,183	4.1
投資信託財産総額	85,950,962	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10日現在

項目	当期末
(A) 資産	**85,950,962,214円**
コール・ローン等	2,623,665,414
投資信託証券(評価額)	82,429,778,300
未収入金	71,005,426
未収配当金	826,513,074
(B) 負債	**216,184,866**
未払金	205,439,866
未払解約金	10,745,000
(C) 純資産総額(A－B)	**85,734,777,348**
元本	38,617,427,276
次期繰越損益金	47,117,350,072
(D) 受益権総口数	**38,617,427,276口**
１万口当り基準価額(C／D)	**22,201円**

＊期首における元本額は34,318,648,308円、当期中における追加設定元本額は4,844,014,638円、同解約元本額は545,235,670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、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）22,432,943円、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）20,660,182円、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）105,047,483円、６資産バランスファンド（分配型）182,305,835円、６資産バランスファンド（成長型）384,008,698円、世界６資産均等分散ファンド（毎月分配型）56,815,849円、『しがぎん』ＳＲＩ三資産バランス・オープン（奇数月分配型）2,504,007円、ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）66,042,040円、成果リレー（ブラジル国債＆Ｊ－ＲＥＩＴ）2014－07 27,499,017円、成果リレー（ブラジル国債＆Ｊ－ＲＥＩＴ）2014－08 36,858,715円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）200,558,243円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）268,488,315円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）331,022,645円、ＤＣダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブファンド387,539,732円、ダイワファンドラップＪ－ＲＥＩＴセレクト35,413,355,208円、ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（成長型）144,044,038円、ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（安定型）46,221,969円、ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（分配型）235,860,350円、ダイワ・アクティブＪリート・ファンド（年４回決算型）686,162,007円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は22,201円です。

■損益の状況

当期　自2017年５月11日　至2017年11月10日

項目	当期
(A) 配当等収益	**1,622,340,128円**
受取配当金	1,622,920,374
支払利息	△ 580,246
(B) 有価証券売買損益	**△ 7,907,479,629**
売買益	525,455,305
売買損	△ 8,432,934,934
(C) 当期損益金(A＋B)	**△ 6,285,139,501**
(D) 前期繰越損益金	**47,833,399,641**
(E) 解約差損益金	**△ 701,841,430**
(F) 追加信託差損益金	**6,270,931,362**
(G) 合計(C＋D＋E＋F)	**47,117,350,072**
次期繰越損益金(G)	**47,117,350,072**

（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。

ダイワ北米好配当株マザーファンド

運用報告書　第24期（決算日　2017年10月16日）

（計算期間　2017年４月18日～2017年10月16日）

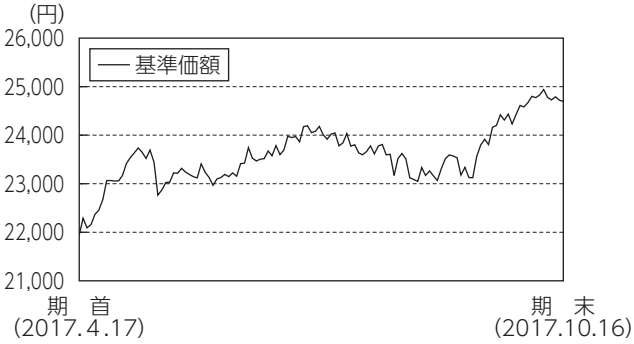
ダイワ北米好配当株マザーファンドの第24期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券
運用方法	①銘柄の選定にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。 ②外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。 ③株式およびハイブリッド優先証券の組入比率は、通常の状態で信託財産の純資産総額の80％程度以上とすることを基本とします。 ④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。
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ノースアメリカ指数(配当込み、円換算)		株式組入比率	ハイブリッド優先証券組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2017年4月17日	21,947	−	23,281	−	71.5	21.9	2.2
4月末	23,056	5.1	24,489	5.2	72.1	21.8	2.1
5月末	23,145	5.5	24,698	6.1	71.7	21.8	2.1
6月末	23,601	7.5	25,074	7.7	72.2	21.6	2.2
7月末	23,635	7.7	25,294	8.6	73.5	21.3	1.9
8月末	23,514	7.1	25,207	8.3	70.3	21.1	1.9
9月末	24,583	12.0	26,360	13.2	73.6	21.2	2.0
(期末)2017年10月16日	24,694	12.5	26,654	14.5	72.0	20.3	2.2

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) MSCIノースアメリカ指数(配当込み、円換算)は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIノースアメリカ指数(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。MSCIノースアメリカ指数(配当込み、米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

《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：21,947円　期末：24,694円　騰落率：12.5%

【基準価額の主な変動要因】

当期は、北米株式市況が堅調に推移したことや米国ハイブリッド優先証券市況が上昇したこと、また米ドルが対円で上昇したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○北米株式市況

北米株式市況は、好調な企業業績などを受けて、堅調に推移しました。

北米株式市況は、朝鮮半島情勢などの地政学リスクの高まりなどを受けて調整する局面も見られましたが、良好な企業決算の発表やフランス大統領選挙の結果を受けた欧州の政治リスクの後退などが支援材料となり、堅調な推移となりました。2017年9月以降は、ハリケーンの影響が想定より小さかったことや米国経済の先行きに楽観的な見方が強まったことが支援材料となり、上昇基調が続きました。

○米国ハイブリッド優先証券市況

米国ハイブリッド優先証券市況は、良好な需給環境を反映し、堅調に推移しました。

米国ハイブリッド優先証券市況は、堅調な相場展開が続きました。2017年8月には、北朝鮮のミサイル発射を受けたリスク回避の動きや金利上昇を背景に軟調に推移する局面もありましたが、相対的に高い利回りを追求する投資家からの需要を反映した良好な需給環境などが下支え要因となり、徐々に値を戻す動きとなりました。

○為替相場

米ドル円為替相場は、金利先高感を背景に上昇（円安）しました。

米ドル円為替相場は、2017年9月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）でFRB（米国連邦準備制度理事会）のバランスシートの縮小開始が決定されたことから、対円で上昇（円安）しました。

◆前期における「今後の運用方針」

外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク（以下、C&S）に運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行なってまいります。普通株式については、今後も長期的なビジネスモデルが確立した銘柄の中から、配当利回り、バリュエーション、キャッシュフローおよび配当の成長などを考慮しながら、ポートフォリオを構築します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

◆ポートフォリオについて

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

有価証券の組入比率は、株式を65～75%程度、ハイブリッド優先証券等を20～30%程度としました。

銘柄選択にあたって、C&Sでは、長期的なビジネスモデルが確立した銘柄に絞って調査しております。当ファンドでは、その中から魅力的な配当利回りを将来にわたって提供できるキャッシュフローを生み出せると考える銘柄を中心にポートフォリオを構築しました。その結果、業種別では、IT（情報技術）セクターや金融セクターを高位で組み入れました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

《今後の運用方針》

外貨建資産の運用にあたっては、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行なってまいります。普通株式については、今後も長期的なビジネスモデルが確立した銘柄の中から、配当利回り、バリュエーション、キャッシュフローおよび配当の成長などを考慮しながら、ポートフォリオを構築します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

■1万口当りの費用の明細

項　目	当　期
売買委託手数料	7円
(株式)	(4)
(ハイブリッド優先証券)	(2)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	0
(株式)	(0)
(ハイブリッド優先証券)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	10
(保管費用)	(10)
(その他)	(0)
合　計	17

(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

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

		買		売	
		株　数	金　額	株　数	金　額
外国	アメリカ	百株 542.12 (－)	千アメリカ・ドル 3,540 (△ 4)	百株 668.79	千アメリカ・ドル 4,398
外国	カナダ	百株 31.56 (－)	千カナダ・ドル 210 (－)	百株 21.49	千カナダ・ドル 157

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

(2) ハイブリッド優先証券

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

		買		売	
		証券数	金　額	証券数	金　額
外国	アメリカ	千証券 56.486 (－)	千アメリカ・ドル 1,451 (－)	千証券 64.703 (－)	千アメリカ・ドル 1,758 (－)

(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) 投資信託証券

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

		買		売	
		口　数	金　額	口　数	金　額
外国	アメリカ	千口 8.116 (△ 0.71)	千アメリカ・ドル 202 (△ 17)	千口 6.653 (－)	千アメリカ・ドル 171 (－)

(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

(1) 株　式

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

当期							
買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ORACLE CORP（アメリカ）	6.269	35,031	5,588	QUALCOMM INC（アメリカ）	6.206	36,265	5,843
INTEL CORP（アメリカ）	6.612	26,622	4,026	HONEYWELL INTERNATIONAL INC（アメリカ）	2.4	36,214	15,089
GILEAD SCIENCES INC（アメリカ）	3	22,489	7,496	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC（アメリカ）	1.7	23,112	13,595
ALASKA AIR GROUP INC（アメリカ）	2.2	21,688	9,858	AETNA INC（アメリカ）	1.1	19,092	17,357
SNAP-ON INC（アメリカ）	1.2	20,132	16,776	HELMERICH & PAYNE（アメリカ）	2.666	17,119	6,421
BIOGEN INC（アメリカ）	0.6	20,006	33,343	PPG INDUSTRIES INC（アメリカ）	1.4	16,803	12,002
ROSS STORES INC（アメリカ）	2.746	16,916	6,160	FIFTH THIRD BANCORP（アメリカ）	5.515	15,962	2,894
EVEREST RE GROUP LTD（バミューダ）	0.537	14,465	26,937	GENERAL DYNAMICS CORP（アメリカ）	0.733	15,812	21,572
TRINSEO SA（ルクセンブルグ）	1.89	13,967	7,390	VIACOM INC-CLASS B（アメリカ）	4.508	15,702	3,483
HOME DEPOT INC（アメリカ）	0.747	12,845	17,195	WESTERN DIGITAL CORP（アメリカ）	1.6	15,292	9,557

（注1）金額は受渡し代金。
（注2）金額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

当期							
買付				売付			
銘柄	証券数	金額	平均単価	銘柄	証券数	金額	平均単価
	千証券	千円	円		千証券	千円	円
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6 H（アメリカ）	6.725	19,698	2,929	NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A.（アメリカ）	6.422	20,847	3,246
ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *（アメリカ）	3.625	9,825	2,710	HUNTINGTON BANCSHARES 6.25 D（アメリカ）	5.5	16,862	3,065
BERKLEY (WR) CORPORATION 5.75（アメリカ）	3.211	9,103	2,835	ASPEN INSURANCE HLDG LTD 5.625 *（バミューダ）	5.175	14,741	2,848
VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B（アメリカ）	3	8,629	2,876	WELLS FARGO & COMPANY 6 V（アメリカ）	3.675	10,884	2,961
BB&T CORPORATION 5.625 E（アメリカ）	2.897	8,139	2,809	DTE ENERGY CO 6 F（アメリカ）	3.4	10,343	3,042
DTE ENERGY CO 6 F（アメリカ）	2.7	7,859	2,910	CITIGROUP INC 7.125 J（アメリカ）	3.125	10,141	3,245
STATE STREET CORP 5.25 C（アメリカ）	2.525	7,063	2,797	ARCH CAPITAL GROUP LTD 5.25 E（バミューダ）	3.3	9,174	2,780
NUSTAR ENERGY LP 7.625 B（アメリカ）	2.5	7,040	2,816	CAPITAL ONE FINANCIAL CO 5.2 G（アメリカ）	2.9	8,130	2,803
CITIGROUP CAPITAL XIII 7.68111（アメリカ）	2.275	7,012	3,082	BANK OF AMERICA CORP 6.625 W（アメリカ）	2.57	7,766	3,021
CHS INC 6.75 3（アメリカ）	2	6,043	3,021	VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B（アメリカ）	2.324	6,843	2,944

（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	
ABBOTT LABORATORIES	45.55	37	202	22,663	ヘルスケア
AETNA INC	25.17	19	290	32,594	ヘルスケア
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9.1	–	–	–	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	24	–	–	–	資本財・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	–	16.86	72	8,135	公益事業
TE CONNECTIVITY LTD	40	26	228	25,568	情報技術
APPLE INC	37	30	470	52,786	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	15	–	–	–	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	25.31	35	167	18,774	電気通信サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	25.83	25	163	18,294	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	34.92	35	335	37,603	金融
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13	9	137	15,424	金融
FIRST AMERICAN FINANCIAL	43	40	200	22,460	金融
CISCO SYSTEMS INC	72	90	301	33,761	情報技術
MORGAN STANLEY	45.37	41	198	22,195	金融
BROADCOM LTD	7.63	5.28	130	14,673	情報技術
TELEFLEX INC	4.5	4.5	107	12,039	ヘルスケア
LYONDELLBASELL INDU-CL A	9	–	–	–	素材
KINDER MORGAN INC	59	–	–	–	エネルギー
EXPEDIA INC	16.37	18	270	30,283	一般消費財・サービス
EXXON MOBIL CORP	28.53	28.53	235	26,351	エネルギー
EVEREST RE GROUP LTD	–	5.37	129	14,475	金融
NEXTERA ENERGY INC	18.25	13	195	21,935	公益事業
GENERAL ELECTRIC CO	43.06	70.63	162	18,191	資本財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	13.88	6.55	139	15,661	資本財・サービス
ALPHABET INC-CL A	5.5	5.75	579	64,953	情報技術
FIFTH THIRD BANCORP	55.15	–	–	–	金融
HOME DEPOT INC	9.71	16	263	29,494	一般消費財・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	110	48.63	66	7,467	金融
HELMERICH & PAYNE	26.66	–	–	–	エネルギー
TRINSEO SA	–	18.9	134	15,124	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	–	12	68	7,726	素材
JOHNSON & JOHNSON	16.96	16.96	231	25,933	ヘルスケア
LINCOLN NATIONAL CORP	17.08	–	–	–	金融
DOWDUPONT INC	–	19.27	137	15,427	素材
NORTHROP GRUMMAN CORP	8.1	5	148	16,610	資本財・サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	17.5	10	97	10,925	一般消費財・サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	26	26	168	18,862	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	44.72	38	247	27,705	生活必需品
PFIZER INC	82	80	290	32,583	ヘルスケア
PROCTER & GAMBLE CO/THE	33.41	33.41	310	34,839	生活必需品
ACCENTURE PLC-CL A	27	23	320	35,883	情報技術
QUALCOMM INC	50	–	–	–	情報技術
ROSS STORES INC	–	27.46	173	19,426	一般消費財・サービス
SCHLUMBERGER LTD	14.68	20	134	15,056	エネルギー
AT&T INC	56	56	199	22,407	電気通信サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	23.88	20	236	26,531	資本財・サービス
ANTHEM INC	11.85	13.26	243	27,320	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	20	20	194	21,828	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	54	37	198	22,265	金融
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11	–	–	–	ヘルスケア
WESTERN DIGITAL CORP	16	–	–	–	情報技術
PPG INDUSTRIES INC	20	6	68	7,632	素材
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	14	9.91	132	14,855	金融
TYSON FOODS INC-CL A	10	25	175	19,672	生活必需品
ORACLE CORP	–	62.69	304	34,154	情報技術
NOBLE ENERGY INC	48	43	116	13,084	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	153	174.02	449	50,379	金融
ANALOG DEVICES INC	25	30	267	29,945	情報技術
ALASKA AIR GROUP INC	–	22	178	19,962	資本財・サービス
AMGEN INC	6.19	–	–	–	ヘルスケア
EATON CORP PLC	30	18	141	15,842	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	–	25	202	22,743	ヘルスケア
INTEL CORP	–	38	150	16,895	情報技術
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	34.4	34.4	192	21,587	金融
SNAP-ON INC	–	12	182	20,444	資本財・サービス
MICROSOFT CORP	45.78	55	426	47,767	情報技術
CVS HEALTH CORP	26.61	40	290	32,548	生活必需品
MEDTRONIC PLC	17.07	15	117	13,125	ヘルスケア
BLACKROCK INC	2.58	–	–	–	金融
CHUBB LTD	14.8	20	297	33,363	金融
BIOGEN INC	–	6	202	22,705	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	35	47	261	29,351	一般消費財・サービス
VIACOM INC-CLASS B	36.95	–	–	–	一般消費財・サービス
アメリカ・ドル通貨計 株数、金額	1,912.05	1,785.38	12,743	1,428,314	
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	62銘柄	60銘柄		<68.7%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
SUNCOR ENERGY INC	34	46	193	17,396	エネルギー
BANK OF NOVA SCOTIA	–	11	88	7,971	金融
ROYAL BANK OF CANADA	18.02	18	178	16,013	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	32.91	25	170	15,345	一般消費財・サービス
ENBRIDGE INC	30	25	129	11,627	エネルギー
カナダ・ドル通貨計 株数、金額	114.93	125	761	68,355	
カナダ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	4銘柄	5銘柄		< 3.3%>	
ファンド合計 株数、金額	2,026.98	1,910.38	–	1,496,669	
ファンド合計 銘柄数<比率>	66銘柄	65銘柄		<72.0%>	

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

(2) ハイブリッド優先証券

銘柄	期首	当期末		
	証券数	証券数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千証券	千証券	千アメリカ・ドル	千円
JPMORGAN CHASE & CO 6.125 Y	3.2	3.2	85	9,629
CHS INC 7.5 4	4.9	4.9	138	15,575
JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA	5.225	5.225	141	15,864
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.2 F	2.475	2.025	54	6,110
WELLS FARGO & COMPANY 6 V	4.177	1.702	45	5,070
SOUTHERN CO 6.25	3.304	1.654	44	5,033
AMERICAN FINANCIAL GROUP 6	1.5	1.5	39	4,480
WELLS FARGO & COMPANY 5.7 W	1.979	2.979	76	8,597
BANK OF AMERICA CORP 6.2 CC	5.282	3.957	105	11,845
CITIGROUP INC 6.3 S	5.6	7.3	196	21,968
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.3 N	1.973	1.973	54	6,063
EBAY INC 6	0.666	0.666	18	2,018
BERKLEY (WR) CORPORATION 5.9	3.55	2.05	53	6,038
CHARLES SCHWAB CORP 5.95 D	1	–	–	–
SCE TRUST V 5.45 K	1	–	–	–
HUNTINGTON BANCSHARES 6.25 D	5.5	–	–	–
STATE STREET CORP 5.35 G	1.038	–	–	–
BANK OF AMERICA CORP 6 EE	4.98	6.755	177	19,949
BERKLEY (WR) CORPORATION 5.75	1.2	4.411	115	12,938
VALIDUS HOLDINGS LTD 5.875 A	0.725	0.7	17	1,998
REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	0.7	–	–	–
WELLS FARGO & COMPANY 5.5 X	1.48	2.48	63	7,074
STIFEL FINANCIAL CORP 6.25 A	2.023	2.023	54	6,065
DOMINION ENERGY INC 5.25 A	1.536	0.836	21	2,400
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 5.2 G	0.66	–	–	–
LEGG MASON INC 5.45	2.4	4.3	107	12,067
QWEST CORP 6.5	1.089	–	–	–
ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	–	3.625	89	10,047
ASPEN INSURANCE HLDG LTD 5.625 *	5.175	–	–	–
ARCH CAPITAL GROUP LTD 5.25 E	3.8	1.825	45	5,085
PEOPLE'S UNITED FIN INC 5.625 A	1.16	–	–	–
MORGAN STANLEY 5.85 K	5.5	6.8	185	20,814
DTE ENERGY CO 6 F	2.325	1.625	44	4,964
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	1.575	1.575	39	4,432
NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A.	7.025	0.603	17	1,961
NUSTAR ENERGY LP 7.625 B	–	2.5	63	7,116
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6 H	–	6.725	178	20,011
VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B	–	0.676	18	2,056
TCF FINANCIAL CO 5.7 C	–	1.45	37	4,197
GEORGIA POWER CO 5 2017	–	1.475	36	4,132
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.7 G	1.75	1.75	44	4,938
BANK OF AMERICA CORP 6.5 Y	4.2	1.975	52	5,923
ALLSTATE CORP 6.75 C	1.7	–	–	–
FIRST REPUBLIC BANK/SF 5.5 D	–	0.597	14	1,668
CHS INC 6.75 3	–	2	54	6,137
HANOVER INSURANCE GROUP 6.35	2.1	2.1	53	6,037
WELLS FARGO & COMPANY 5.2	–	2.125	53	5,966
CITIGROUP INC 6.875 K	2.414	1.214	35	3,954
CITIGROUP CAPITAL XIII 7.68111	–	2.275	62	7,027
PARTNERRE LTD 6.5 G	4.576	4.576	124	13,991
MORGAN STANLEY 6.875 F	2.707	2.707	78	8,753
ALLY FINANCIAL 7.1000 2/15/40	6.575	6.575	174	19,506
PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P	0.7	–	–	–
BB&T CORPORATION 5.85	1	1	25	2,846
BANK OF AMERICA CORP 6.625 W	2.57	–	–	–
ALLSTATE CORP 6.625 E	1.8	–	–	–
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K	0.9	–	–	–
QWEST CORP 7	0.6	1.75	44	4,993
MORGAN STANLEY 6.625 G	1.5	–	–	–
BB&T CORPORATION 5.625 E	–	2.897	73	8,221
MORGAN STANLEY 6.375 I	3.325	3.325	93	10,468
NUSTAR LOGISTICS LP 7.625	2.5	4.275	108	12,122
REINSURANCE GRP OF AMER 6.2	–	0.375	10	1,190
STATE STREET CORP 5.25 C	–	2.525	63	7,077
STATE STREET CORP 5.9 D	2.35	2.35	65	7,290
WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	3.747	2.988	81	9,085
CITIGROUP INC 7.125 J	3.763	0.638	18	2,062
JPMORGAN CHASE & CO 6.3 W	0.7	–	–	–
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.7 D	2.1	2.1	56	6,364
HARTFORD FINL SVCS GRP 7.875	0.55	–	–	–
合計 証券数、金額	149.849	141.632	3,758	421,238
合計 銘柄数<比率>	57銘柄	53銘柄		<20.3%>

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

(3) 外国投資信託証券

銘柄	期首	当期末		
	□数	□数	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
SUNSTONE HOTEL INVESTORS 6.95 E	0.793	0.793	21	2,373
AMERICAN HOMES 4 RENT 6.5 D	0.563	0.563	15	1,681
AMERICAN HOMES 4 RENT 6.35 E	1.5	1.5	39	4,436
NATIONAL RETAIL PROP INC 5.2 F	–	0.597	14	1,663
PUBLIC STORAGE 4.9 E	0.567	–	–	–
COLONY NORTHSTAR INC 8.75 E	1.75	1.75	46	5,262
COLONY NORTHSTAR INC 7.15 I	–	0.7	17	1,965
GLOBAL NET LEASE INC 7.25 A	–	1.1	27	3,048
NATIONAL STORAGE AFFILIA 6 A	–	1.8	45	5,055
NATIONAL RETAIL PROP INC 5.7 E	0.8	1.058	26	2,964
RETAIL PROPERTIES OF AME 7 A	2	2	50	5,684
GRAMERCY PROPERTY TRUST 7.125 A	1.7	1.7	45	5,077
DDR CORP 6.5 J	1	1	25	2,809
CHESAPEAKE LODGING TRUST 7.75 A	0.71	–	–	–
VEREIT INC 6.7 F	3.826	1.401	36	4,044
合計 口数、金額	15.209	15.962	411	46,068
合計 銘柄数<比率>	11銘柄	13銘柄		<2.2%>

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

■投資信託財産の構成

2017年10月16日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	1,496,670	70.9
ハイブリッド優先証券	421,238	20.0
投資信託証券	46,068	2.2
コール・ローン等、その他	145,540	6.9
投資信託財産総額	2,109,518	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。
（注2）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、10月16日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝112.08円、1カナダ・ドル＝89.79円です。
（注3）当期末における外貨建純資産（2,042,008千円）の投資信託財産総額（2,109,518千円）に対する比率は、96.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年10月16日現在

項目	当期末
(A) 資産	**2,109,518,388円**
コール・ローン等	87,069,247
株式(評価額)	1,496,670,000
ハイブリッド優先証券(評価額)	421,238,735
投資信託証券(評価額)	46,068,997
未収入金	54,881,207
未収配当金	2,261,080
未収利息	1,329,122
(B) 負債	**30,656,103**
未払金	28,217,103
未払解約金	2,439,000
(C) 純資産総額(A－B)	**2,078,862,285**
元本	841,857,223
次期繰越損益金	1,237,005,062
(D) 受益権総口数	**841,857,223口**
1万口当り基準価額(C／D)	**24,694円**

＊期首における元本額は894,216,973円、当期中における追加設定元本額は40,454,566円、同解約元本額は92,814,316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、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）13,527,132円、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）12,337,501円、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）235,410,291円、ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド40,515,382円、ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）41,039,180円、米国好配当株オープン（予想分配金提示型）435,875円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）81,513,533円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）163,008,714円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）254,069,615円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は24,694円です。

■損益の状況

当期　自2017年4月18日　至2017年10月16日

項目	当期
(A) 配当等収益	**28,941,557円**
受取配当金	15,992,960
受取利息	12,047,095
その他収益金	912,894
支払利息	△ 11,392
(B) 有価証券売買損益	**215,821,402**
売買益	257,123,722
売買損	△ 41,302,320
(C) その他費用	**△ 884,879**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**243,878,080**
(E) 前期繰越損益金	**1,068,287,232**
(F) 解約差損益金	**△ 129,387,684**
(G) 追加信託差損益金	**54,227,434**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**1,237,005,062**
次期繰越損益金(H)	**1,237,005,062**

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

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

運用報告書　第24期（決算日　2017年10月16日）

（計算期間　2017年４月18日～2017年10月16日）

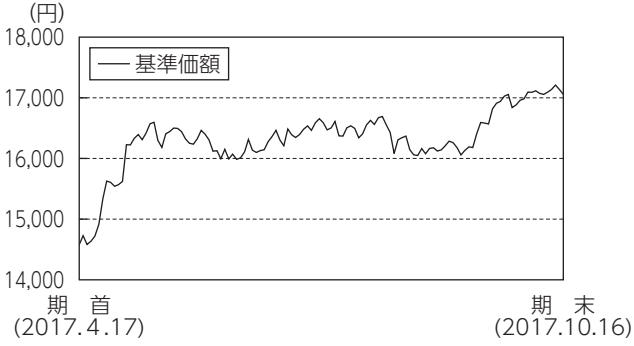
ダイワ欧州好配当株マザーファンドの第24期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
運用方法	①銘柄の選定にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。 ②外貨建資産の運用にあたっては、パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。 ③株式の組入比率は、通常の状態で信託財産の純資産総額の80％程度以上とすることを基本とします。 ④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。
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ヨーロッパ指数（配当込み、円換算）		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2017年4月17日	14,580	−	15,767	−	97.2	−
4月末	15,542	6.6	16,906	7.2	97.3	−
5月末	16,235	11.4	17,627	11.8	96.2	−
6月末	16,303	11.8	17,808	12.9	94.4	−
7月末	16,340	12.1	17,925	13.7	95.9	−
8月末	16,211	11.2	17,866	13.3	93.2	−
9月末	16,981	16.5	18,832	19.4	94.8	−
(期末)2017年10月16日	17,056	17.0	19,026	20.7	95.8	−

（注1）騰落率は期首比。
（注2）ＭＳＣＩヨーロッパ指数（配当込み、円換算）は、ＭＳＣＩ Ｉｎｃ．の承諾を得て、ＭＳＣＩヨーロッパ指数（配当込み、ユーロベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。ＭＳＣＩヨーロッパ指数（配当込み、ユーロベース）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：14,580円　期末：17,056円　騰落率：17.0%

【基準価額の主な変動要因】

欧州株式市場が上昇したことやユーロが対円で上昇したことなど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

○欧州株式市況

欧州株式市場は上昇しました。

期首から2017年５月中旬にかけての欧州株式市況は、フランスの大統領選挙で親ＥＵ（欧州連合）派のマクロン氏が勝利するとの見方が広がったことなどから上昇しました。その後は、ドラギＥＣＢ（欧州中央銀行）総裁の発言を受けた長期金利の上昇やユーロ高の進行、ドイツ自動車会社によるカルテル疑惑、北朝鮮情勢の緊迫化、スペインでのテロ事件などを背景に、８月にかけて下落基調となりました。期末にかけては、原油価格の上昇や良好な経済指標の発表などが支援材料となり、上昇しました。

○為替相場

ユーロは対円で上昇しました。

期首から2017年７月にかけてのユーロの対円為替相場は、フランスの大統領選挙で親ＥＵ派のマクロン氏が勝利するとの見方が広がったことで欧州の政治リスクが後退したこと、欧州各国の中央銀行総裁の発言を受けた量的金融緩和の縮小観測などを背景に、上昇しました。その後も、北朝鮮情勢の緊迫化を受けて調整する局面は見られましたが、米国の経済シンポジウム（ジャクソンホール会議）でのドラギＥＣＢ総裁の発言に一部で懸念されていたユーロ高をけん制する内容がなかったことなどから、期末にかけて上昇基調となりました。

◆前期における「今後の運用方針」

外貨建資産の運用にあたっては、パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッド（以下、パイオニア社）に運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強固で、安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

◆ポートフォリオについて

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

株式組入比率は高位に維持しました。銘柄選定にあたって、パイオニア社では、収益基盤が強固で安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資しました。そのような運用方針において、セクター別では、金融セクターやヘルスケアセクター、個別銘柄では、NESTLE（スイス、生活必需品）、HSBC HOLDINGS（英国、金融）、SCHNEIDER ELECTRIC（フランス、資本財・サービス）などを高位に組み入れました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

《今後の運用方針》

外貨建資産の運用にあたっては、パイオニア社に運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行なってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強固で、安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

■1万口当りの費用の明細

項　目	当　期
売買委託手数料	1円
(株式)	(1)
有価証券取引税	1
(株式)	(1)
その他費用	13
(保管費用)	(11)
(その他)	(1)
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は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況
株　式

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
外国	イギリス	百株 138.43 (△ 18.47)	千イギリス・ポンド 47 (−)	百株 931.46	千イギリス・ポンド 346
	スイス	百株 − (−)	千スイス・フラン − (−)	百株 31.72	千スイス・フラン 271
	スウェーデン	百株 − (−)	千スウェーデン・クローネ − (−)	百株 74.92	千スウェーデン・クローネ 2,121
	ユーロ (オランダ)	百株 − (−)	千ユーロ − (−)	百株 46.7	千ユーロ 68
	ユーロ (フランス)	百株 4.07 (−)	千ユーロ 20 (△ 9)	百株 14.52	千ユーロ 101
	ユーロ (ドイツ)	百株 − (−)	千ユーロ − (−)	百株 11.56	千ユーロ 154
外国	ユーロ (イタリア)	百株 189.67 (−)	千ユーロ 78 (△ 4)	百株 −	千ユーロ −
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 193.74 (−)	千ユーロ 98 (△14)	百株 72.78	千ユーロ 325

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

■主要な売買銘柄
株　式

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

当期 買付 銘柄	株数	金額	平均単価	当期 売付 銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
DIXONS CARPHONE PLC(イギリス)	13.843	6,742	487	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B(スウェーデン)	6.228	23,558	3,782
INTESA SANPAOLO(イタリア)	10.981	4,199	382	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(イギリス)	2.217	16,847	7,599
ENEL SPA(イタリア)	7.06	4,000	566	NESTLE SA-REG(スイス)	1.827	16,118	8,822
CASINO GUICHARD PERRACHON(フランス)	0.407	2,724	6,693	ALLIANZ SE-REG(ドイツ)	0.545	13,005	23,862
ENI SPA(イタリア)	0.926	1,721	1,859	DIXONS CARPHONE PLC(イギリス)	43.909	12,018	273
				NOVARTIS AG-REG(スイス)	1.222	10,842	8,872
				KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N(オランダ)	4.67	9,045	1,936
				BNP PARIBAS(フランス)	1.07	8,482	7,927
				HSBC HOLDINGS PLC(イギリス)	8.642	7,825	905
				BASF SE(ドイツ)	0.611	6,880	11,261

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
外国株式

銘柄		期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
PRUDENTIAL PLC		148.44	148.44	271	40,436	金融
AVIVA PLC		406.69	406.69	203	30,278	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC		159	159	241	35,920	ヘルスケア
DIXONS CARPHONE PLC		300.66	－	－	－	一般消費財・サービス
VODAFONE GROUP PLC		900.05	676.54	145	21,741	電気通信サービス
KINGFISHER PLC		467.78	307.51	95	14,173	一般消費財・サービス
NATIONAL GRID PLC		221.59	203.12	189	28,204	公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		72.64	50.47	245	36,537	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		520.46	434.04	320	47,798	金融
CARNIVAL PLC		31.11	31.11	155	23,180	一般消費財・サービス
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		117.61	117.61	268	40,056	エネルギー
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額	3,346.03	2,534.53	2,136	318,327	
	銘柄数<比率>	11銘柄	10銘柄		<24.1%>	
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		10.29	10.29	251	28,936	ヘルスケア
NESTLE SA-REG		76.85	58.58	497	57,121	生活必需品
ZURICH INSURANCE GROUP AG		11.57	10.34	305	35,065	金融
NOVARTIS AG-REG		56.11	43.89	368	42,317	ヘルスケア
GIVAUDAN-REG		1.38	1.38	299	34,429	素材
スイス・フラン通貨計	株数、金額	156.2	124.48	1,721	197,871	
	銘柄数<比率>	5銘柄	5銘柄		<15.0%>	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
DNB ASA		142.81	142.81	2,244	31,856	金融
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額	142.81	142.81	2,244	31,856	
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		< 2.4%>	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
NORDEA BANK AB		180.77	180.77	1,948	26,950	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		123.5	110.86	2,371	32,795	金融
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		62.28	－	－	－	素材
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額	366.55	291.63	4,319	59,745	
	銘柄数<比率>	3銘柄	2銘柄		< 4.5%>	
ユーロ(オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE PHILIPS NV		83.94	83.94	290	38,467	ヘルスケア
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		111.76	65.06	102	13,572	生活必需品
KONINKLIJKE DSM NV		37.98	37.98	274	36,323	素材
KONINKLIJKE KPN NV		633.42	633.42	187	24,851	電気通信サービス
国小計	株数、金額	867.1	820.4	855	113,214	
	銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄		< 8.6%>	
ユーロ(フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
TOTAL SA		62.99	62.99	288	38,182	エネルギー
SCHNEIDER ELECTRIC SE		46.76	46.76	342	45,290	資本財・サービス
BNP PARIBAS		50.6	39.9	263	34,895	金融
CASINO GUICHARD PERRACHON		34.63	38.7	186	24,745	生活必需品
SANOFI		40.64	36.82	307	40,757	ヘルスケア
国小計	株数、金額	235.62	225.17	1,388	183,871	
	銘柄数<比率>	5銘柄	5銘柄		<13.9%>	
ユーロ(ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS AG-REG		24.89	24.89	298	39,515	資本財・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		29.96	29.96	261	34,620	一般消費財・サービス
BASF SE		38.29	32.18	286	37,879	素材
ALLIANZ SE-REG		16.19	10.74	210	27,808	金融
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		11.83	11.83	218	28,923	金融
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		211.45	211.45	326	43,257	電気通信サービス
国小計	株数、金額	332.61	321.05	1,601	212,004	
	銘柄数<比率>	6銘柄	6銘柄		<16.0%>	
ユーロ(スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ENAGAS SA		101.15	101.15	246	32,612	エネルギー
国小計	株数、金額	101.15	101.15	246	32,612	
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		< 2.5%>	
ユーロ(イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
INTESA SANPAOLO		572.62	682.43	195	25,843	金融
ENI SPA		139.23	148.49	207	27,467	エネルギー
ENEL SPA		410.93	481.53	248	32,963	公益事業
国小計	株数、金額	1,122.78	1,312.45	651	86,273	
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		< 6.5%>	
ユーロ(フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
NOKIA OYJ		477.05	477.05	238	31,614	情報技術
国小計	株数、金額	477.05	477.05	238	31,614	
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		< 2.4%>	
ユーロ通貨計	株数、金額	3,136.31	3,257.27	4,981	659,592	
	銘柄数<比率>	20銘柄	20銘柄		<49.9%>	
ファンド合計	株数、金額	7,147.9	6,350.72	－	1,267,392	
	銘柄数<比率>	40銘柄	38銘柄		<95.8%>	

(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。

■投資信託財産の構成

2017年10月16日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	1,267,392	95.6
コール・ローン等、その他	58,614	4.4
投資信託財産総額	1,326,006	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。
（注2）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、10月16日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝112.08円、1イギリス・ポンド＝149.02円、1スイス・フラン＝114.92円、1デンマーク・クローネ＝17.79円、1ノルウェー・クローネ＝14.19円、1スウェーデン・クローネ＝13.83円、1ユーロ＝132.41円です。
（注3）当期末における外貨建純資産（1,312,542千円）の投資信託財産総額（1,326,006千円）に対する比率は、99.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年10月16日現在

項目	当期末
(A) 資産	**1,326,006,920円**
コール・ローン等	57,464,540
株式(評価額)	1,267,392,333
未収配当金	1,150,047
(B) 負債	**3,004,000**
未払解約金	3,004,000
(C) 純資産総額(A－B)	**1,323,002,920**
元本	775,665,744
次期繰越損益金	547,337,176
(D) 受益権総口数	**775,665,744口**
1万口当り基準価額(C／D)	**17,056円**

＊期首における元本額は862,424,157円、当期中における追加設定元本額は31,858,564円、同解約元本額は118,616,977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、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）19,996,703円、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）18,001,569円、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）340,020,819円、ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド58,916,986円、ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）59,384,367円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）45,760,948円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）92,074,821円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）141,509,531円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は17,056円です。

■損益の状況

当期　自2017年４月18日　至2017年10月16日

項目	当期
(A) 配当等収益	**27,150,512円**
受取配当金	27,235,136
受取利息	146
支払利息	△ 84,770
(B) 有価証券売買損益	**182,101,138**
売買益	226,993,920
売買損	△ 44,892,782
(C) その他費用	**△ 1,029,783**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**208,221,867**
(E) 前期繰越損益金	**394,994,896**
(F) 解約差損益金	**△ 75,289,023**
(G) 追加信託差損益金	**19,409,436**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**547,337,176**
次期繰越損益金(H)	**547,337,176**

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

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

運用報告書　第24期（決算日　2017年10月16日）

（計算期間　2017年４月18日～2017年10月16日）

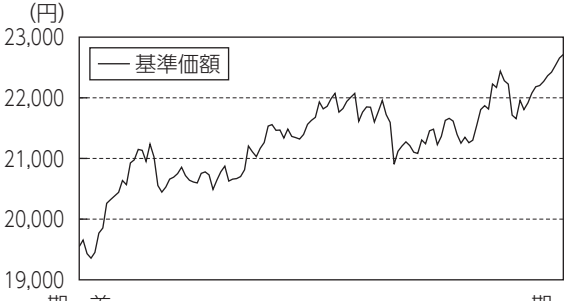
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの第24期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
運用方法	①銘柄の選定にあたっては、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮します。 ②株式の組入比率は、通常の状態で信託財産の純資産総額の80％程度以上とすることを基本とします。 ③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。
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パシフィック指数(除く日本、配当込み、円換算)(参考指数)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率				
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2017年4月17日	19,548	−	22,404	−	91.5	−	−	3.5
4月末	20,383	4.3	22,951	2.4	94.7	−	−	3.3
5月末	20,612	5.4	22,672	1.2	91.5	−	−	3.4
6月末	21,469	9.8	23,723	5.9	94.6	−	−	2.0
7月末	21,613	10.6	23,977	7.0	98.2	−	−	−
8月末	21,627	10.6	23,923	6.8	95.3	−	−	0.8
9月末	21,806	11.6	24,367	8.8	93.3	−	−	0.8
(期末)2017年10月16日	22,714	16.2	24,904	11.2	96.2	−	−	0.8

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) MSCIパシフィック指数(除く日本、配当込み、円換算)は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIパシフィック指数(除く日本、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。MSCIパシフィック指数(除く日本、配当込み、米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
(注4) 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:19,548円　期末:22,714円　騰落率:16.2%

【基準価額の主な変動要因】

当期の基準価額は、主としてアジア・オセアニア株式市況の上昇や投資対象国通貨の対円での上昇を反映して、上昇しました。株価は、中国や韓国、台湾のIT(情報技術)関連銘柄を中心に上昇しました。為替は、世界的な株式市況の上昇を背景に安全資産とされる円の売り圧力が強まりました。

◆投資環境について

○アジア・オセアニア株式市況

アジア・オセアニア株式市況は上昇しました。北朝鮮情勢への警戒感から上値が重くなる局面もありましたが、フランス大統領選挙の投票結果を受けたEU(欧州連合)情勢をめぐる混乱の回避や、韓国新大統領による景気刺激策に対する期待、中国インターネット関連企業の好業績や中国国有企業改革の進展期待、米国の早期追加利上げへの懸念の後退などが支援材料となり、アジア株式市場は上昇しました。

○為替相場

香港ドルは米ドルペッグ制(米ドルに連動する政策)を採用しているため、米ドルに連動した値動きとなりました。米ドルは、世界的な株式市況の上昇を背景に安全資産とされる円の売り圧力が強まったことから、対円で上昇しました。オーストラリア・ドル、韓国ウォン、台湾ドル、シンガポール・ドルも、同様に対円で上昇しました。

◆前期における「今後の運用方針」

オーストラリアや中国、台湾、韓国を中心に市場分散に配慮したポートフォリオとする方針です。国や業種の投資比率の決定にあたっては、政策や消費動向や企業業績等の変化等を注視します。個別銘柄では、革新的な製品・サービスの提供や高い技術力などを背景として、市場予想を上回る業績が期待できる企業を選別して投資を行ないます。また、高い成長性や業績の安定性などを背景に今後株式市場での認知度の高まりが見込まれる中小型株の発掘にも注力していきます。

◆ポートフォリオについて

オーストラリアや中国、台湾、韓国を中心に、高い利益成長が見込まれた銘柄や予想配当利回りが高いと判断された銘柄などを組み入れました。国別では、国際商品市況の上昇などから素材関連銘柄の堅調な株価動向が見込まれたオーストラリアや、IT関連企業を中心に業績の拡大が見込まれた中国を組入高位としました。個別銘柄では、半導体の売上高の増加が見込まれた韓国の半導体メーカーを組入高位としました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

参考指数は、アジア・オセアニア企業で構成されるMSCIパシフィック指数(除く日本、配当込み、円換算)を代表的な指数として掲載しております。

《今後の運用方針》

オーストラリアや中国、台湾、韓国を中心に市場分散に配慮したポートフォリオとする方針です。革新的な製品・サービスの提供や高い技術力などを背景として、市場予想を上回る業績が期待できる企業を選別して投資を行ないます。また、高い成長性や業績の安定性などを背景に今後株式市場での認知度の高まりが見込まれる中小型株の発掘にも注力していきます。

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	148円
(株式)	(146)
(投資信託証券)	(2)
有価証券取引税	46
(株式)	(46)
その他費用	46
(保管費用)	(36)
(その他)	(10)
合計	241

(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

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 90 (－)	千アメリカ・ドル 896 (－)	百株 96	千アメリカ・ドル 563
	オーストラリア	百株 3,492 (△600)	千オーストラリア・ドル 2,926 (△163)	百株 2,515.73	千オーストラリア・ドル 3,494
	香港	百株 21,524 (－)	千香港ドル 24,530 (－)	百株 30,890	千香港ドル 28,223
	シンガポール	百株 3,261 (－)	千シンガポール・ドル 1,009 (－)	百株 10,419	千シンガポール・ドル 1,294
	台湾	百株 7,590 (11)	千台湾ドル 80,350 (－)	百株 6,625.54	千台湾ドル 68,732
	韓国	百株 322.5 (－)	千韓国ウォン 1,347,153 (－)	百株 332.4	千韓国ウォン 1,415,208

(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

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	オーストラリア	千口 35 (－)	千オーストラリア・ドル 81 (－)	千口 119.5 (－)	千オーストラリア・ドル 370 (－)

(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

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

当期 買付				当期 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
NETEASE INC-ADR（ケイマン諸島）	1.8	58,746	32,637	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC（台湾）	82	62,076	757
QANTAS AIRWAYS LTD（オーストラリア）	88	36,146	410	WOODSIDE PETROLEUM LTD（オーストラリア）	18	47,036	2,613
SUNNY OPTICAL TECH（ケイマン諸島）	33	31,951	968	CNOOC LTD（香港）	290	35,720	123
TENCENT HOLDINGS LTD（ケイマン諸島）	7.9	29,189	3,694	NETEASE INC-ADR（ケイマン諸島）	1	32,207	32,207
BHP BILLITON LIMITED（オーストラリア）	13.5	28,909	2,141	HANA FINANCIAL GROUP（韓国）	6.6	29,964	4,540
AMCOR LIMITED（オーストラリア）	19.5	25,694	1,317	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H（中国）	320	28,718	89
DBS GROUP HOLDINGS LTD（シンガポール）	15.7	25,290	1,610	CHALLENGER LTD（オーストラリア）	25.5	28,458	1,116
ASPEED TECHNOLOGY INC（台湾）	10	24,842	2,484	QANTAS AIRWAYS LTD（オーストラリア）	59	27,966	474
CNOOC LTD（香港）	200	24,633	123	DBS GROUP HOLDINGS LTD（シンガポール）	15.7	26,469	1,685
BIZLINK HOLDING INC（ケイマン諸島）	28	24,385	870	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD（オーストラリア）	10.4	26,412	2,539

(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	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	17	10	178	20,000	情報技術
BAIDU INC - SPON ADR	−	3	78	8,832	情報技術
TARENA INTERNATIONAL INC-ADR	57	−	−	−	一般消費財・サービス
SILICON MOTION TECHNOL-ADR	−	21	109	12,222	情報技術
CHANGYOU.COM LTD-ADR	−	26	103	11,644	情報技術
NETEASE INC-ADR	−	8	223	25,074	情報技術
アメリカ・ドル通貨計 株数、金額	74	68	693	77,774	
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	2銘柄	5銘柄		<8.2%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
BHP BILLITON LIMITED	96	135	355	31,418	素材
SOUTH32 LTD	130	130	41	3,707	素材
ALUMINA LTD	−	820	183	16,217	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	120	−	−	−	エネルギー
OZ MINERALS LTD	−	210	169	14,925	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	140	−	−	−	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	104	56	180	15,905	金融
CYBG PLC - CDI	51	51	26	2,305	金融
WESTPAC BANKING CORP	90	90	297	26,222	金融
AUST AND NZ BANKING GROUP	82	60	180	15,923	金融
RIO TINTO LTD	20	50	341	30,111	素材
AMCOR LIMITED	100	120	187	16,559	素材
TREASURY WINE ESTATES LTD	130	130	186	16,493	生活必需品
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	34.73	−	−	−	金融
QBE INSURANCE GROUP LTD	95	−	−	−	金融
QANTAS AIRWAYS LTD	−	290	182	16,156	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	−	100	35	3,107	電気通信サービス
MACQUARIE GROUP LTD	23	−	−	−	金融
BORAL LTD	235	235	160	14,129	素材
CHALLENGER LTD	125	−	−	−	金融
DOWNER EDI LTD	−	200	138	12,254	資本財・サービス
TATTS GROUP LTD	375	−	−	−	一般消費財・サービス
DUET GROUP	600	−	−	−	公益事業
ORORA LTD	−	250	80	7,107	素材
オーストラリア・ドル通貨計 株数、金額	2,550.73	2,927	2,747	242,545	
オーストラリア・ドル通貨計 銘柄数<比率>	18銘柄	16銘柄		<25.5%>	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	−	350	943	13,545	一般消費財・サービス
ANGANG STEEL CO LTD-H	1,400	−	−	−	素材
CHINA GAS HOLDINGS LTD	−	280	694	9,971	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,200	−	−	−	エネルギー
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	−	30	658	9,460	金融
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	860	−	−	−	一般消費財・サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	170	−	−	−	情報技術
TENCENT HOLDINGS LTD	−	19	663	9,527	情報技術
ZTE CORP-H	1,360	400	1,164	16,715	情報技術
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	−	2,000	800	11,488	不動産
CNOOC LTD	900	−	−	−	エネルギー
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	4,500	−	−	−	不動産
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	−	180	558	8,025	素材
YANGTZE OPTICAL FIBRE AND-H	−	200	612	8,788	情報技術
PC PARTNER GROUP LTD	−	2,300	853	12,253	情報技術
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	860	−	−	−	ヘルスケア
AIA GROUP LTD	−	150	917	13,171	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	−	500	645	9,262	不動産
BBMG CORP-H	−	1,400	554	7,961	素材
SUNNY OPTICAL TECH	−	60	731	10,502	情報技術
YESTAR HEALTHCARE HOLDINGS	5,790	1,765	612	8,794	ヘルスケア
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	−	540	380	5,459	素材
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	−	300	639	9,176	一般消費財・サービス
LONGFOR PROPERTIES	800	−	−	−	不動産
香港ドル通貨計 株数、金額	19,840	10,474	11,427	164,103	
香港ドル通貨計 銘柄数<比率>	10銘柄	16銘柄		<17.2%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
KEPPEL CORP LTD	240	−	−	−	資本財・サービス
CAPITALAND LTD	−	265	99	8,225	不動産
SEMBCORP MARINE LTD	750	−	−	−	資本財・サービス
MM2 ASIA LTD	6,800	2,000	99	8,216	一般消費財・サービス
JUMBO GROUP LTD	2,000	−	−	−	一般消費財・サービス
VALUETRONICS HOLDINGS LTD	−	1,100	103	8,626	情報技術
SUNNINGDALE TECH LTD	−	500	109	9,045	資本財・サービス
GENTING SINGAPORE PLC	1,600	−	−	−	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	−	107	196	16,330	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	−	500	185	15,353	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	510	270	90	7,551	資本財・サービス
ROTARY ENGINEERING LTD	440	440	19	1,643	資本財・サービス
シンガポール・ドル通貨計 株数、金額	12,340	5,182	903	74,991	
シンガポール・ドル通貨計 銘柄数<比率>	7銘柄	8銘柄		<7.9%>	
(台湾)	百株	百株	千台湾ドル	千円	
GENERAL INTERFACE SOLUTION	−	70	2,145	7,981	情報技術
RICHWAVE TECHNOLOGY CORP	−	280	2,982	11,093	情報技術
PRIMAX ELECTRONICS LTD	660	360	2,844	10,579	情報技術
MITAC HOLDINGS CORP	1,995.54	1,540	5,759	21,425	情報技術
PIXART IMAGING INC	−	200	2,530	9,411	情報技術
SUNONWEALTH ELECTRIC MACHINE	−	470	2,754	10,245	資本財・サービス
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	−	500	3,200	11,904	情報技術
CHROMA ATE INC	450	240	3,096	11,517	情報技術
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	−	60	2,679	9,965	資本財・サービス
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	−	90	2,619	9,742	資本財・サービス
INVENTEC CORP	−	1,600	3,776	14,046	情報技術
MERRY ELECTRONICS CO LTD	−	190	4,170	15,514	情報技術
GOURMET MASTER CO LTD	−	121	4,210	15,664	一般消費財・サービス
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	800	−	−	−	金融
WIN SEMICONDUCTORS CORP	−	120	2,796	10,401	情報技術
BIZLINK HOLDING INC	170	180	5,337	19,853	資本財・サービス
ASPEED TECHNOLOGY INC	−	50	3,415	12,703	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	820	210	4,987	18,553	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	千台湾ドル	千円	
HON HAI PRECISION INDUSTRY		410	–	–	–	情報技術
台湾ドル通貨計	株数、金額	5,305.54	6,281	59,302	220,603	
	銘柄数<比率>	7銘柄	17銘柄		<23.1%>	
(韓国)		百株	百株	千韓国ウォン	千円	
SK HYNIX INC		22	–	–	–	情報技術
WONIK IPS CO LTD		42	–	–	–	情報技術
NETMARBLE GAMES CORP		–	5.4	87,480	8,704	情報技術
E-MART INC		4.9	–	–	–	生活必需品
NCSOFT CORP		–	2	85,400	8,497	情報技術
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD		–	21	106,470	10,593	金融
DONGBU INSURANCE CO LTD		14.3	–	–	–	金融
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD		2.8	3.7	999,000	99,400	情報技術
HUCHEMS FINE CHEMICAL CORP		71	–	–	–	素材
MACQUARIE KOREA INFRA FUND		–	115	98,900	9,840	その他
韓国ウォン通貨計	株数、金額	157	147.1	1,377,250	137,036	
	銘柄数<比率>	6銘柄	5銘柄		<14.4%>	
ファンド合計	株数、金額	40,267.27	25,079.1	–	917,055	
	銘柄数<比率>	50銘柄	67銘柄		<96.2%>	

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

(2) 外国投資信託証券

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				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
MIRVAC GROUP		100	35	81	7,200
GOODMAN GROUP		19.5	–	–	–
合計	口数、金額	119.5	35	81	7,200
	銘柄数<比率>	2銘柄	1銘柄		<0.8%>

(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。

■投資信託財産の構成

2017年10月16日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	917,055	94.0
投資信託証券	7,200	0.7
コール・ローン等、その他	50,882	5.3
投資信託財産総額	975,138	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、10月16日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝112.08円、1オーストラリア・ドル＝88.29円、1香港ドル＝14.36円、1シンガポール・ドル＝82.99円、1台湾ドル＝3.72円、100韓国ウォン＝9.95円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（955,364千円）の投資信託財産総額（975,138千円）に対する比率は、98.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年10月16日現在

項目	当期末
(A) 資産	**985,070,620円**
コール・ローン等	30,868,068
株式(評価額)	917,055,671
投資信託証券(評価額)	7,200,050
未収入金	29,497,667
未収配当金	449,164
(B) 負債	**32,093,507**
未払金	28,497,507
未払解約金	3,596,000
(C) 純資産総額(A－B)	**952,977,113**
元本	419,550,579
次期繰越損益金	533,426,534
(D) 受益権総口数	**419,550,579口**
1万口当り基準価額(C／D)	**22,714円**

＊期首における元本額は476,718,651円、当期中における追加設定元本額は5,663,231円、同解約元本額は62,831,303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、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）15,384,748円、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）14,139,843円、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）259,955,281円、ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド45,220,653円、ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）45,621,905円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）6,328,297円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）12,734,484円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）20,165,368円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は22,714円です。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

■損益の状況

当期　自2017年４月18日　至2017年10月16日

項目	当期
(A) 配当等収益	**17,949,366円**
受取配当金	17,941,324
受取利息	12,256
支払利息	△ 4,214
(B) 有価証券売買損益	**127,428,344**
売買益	182,213,745
売買損	△ 54,785,401
(C) その他費用	**△ 2,047,861**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**143,329,849**
(E) 前期繰越損益金	**455,148,613**
(F) 解約差損益金	**△ 71,426,697**
(G) 追加信託差損益金	**6,374,769**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**533,426,534**
次期繰越損益金(H)	**533,426,534**

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

ダイワ好配当日本株マザーファンド

運用報告書　第25期（決算日　2017年10月16日）

（計算期間　2017年４月18日～2017年10月16日）

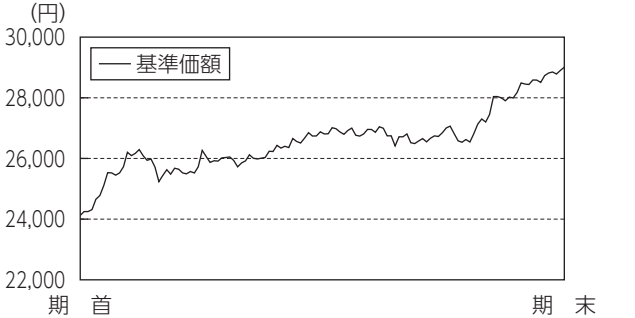
ダイワ好配当日本株マザーファンドの第25期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★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	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。以下同じ。）
運用方法	①主としてわが国の金融商品取引所上場株式に投資して、高水準の配当収入の確保と、値上がり益の獲得をめざします。 ②株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。 ③株式の組入比率は、通常の状態で信託財産の純資産総額の80％程度以上とすることを基本とします。 ④Ｊ－ＲＥＩＴ（不動産投資信託証券）に投資することがあります。Ｊ－ＲＥＩＴへの投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。当該Ｊ－ＲＥＩＴは、外貨建資産を保有する場合があります。
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		TOPIX		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2017年4月17日	24,124	−	1,465.69	−	92.6	−	0.2
4月末	25,450	5.5	1,531.80	4.5	95.3	−	0.1
5月末	25,522	5.8	1,568.37	7.0	94.7	−	0.1
6月末	26,341	9.2	1,611.90	10.0	95.0	−	0.1
7月末	26,737	10.8	1,618.61	10.4	95.2	1.5	−
8月末	27,007	12.0	1,617.41	10.4	89.7	1.5	−
9月末	28,454	17.9	1,674.75	14.3	93.0	2.2	−
(期末)2017年10月16日	29,006	20.2	1,719.18	17.3	92.7	4.2	−

(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：24,124円　期末：29,006円　騰落率：20.2%

【基準価額の主な変動要因】

国内株式市況は、地政学リスクなどにより伸び悩む場面もありましたが、基本的には堅調な企業業績を背景として上昇し、それを反映して基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、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。2017年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。9月半ば以降は、米国の年内利上げ観測が再び高まり円安米ドル高となったことや、北朝鮮問題の懸念が一服したことにより、株価は上昇しました。

◆前期における「今後の運用方針」

国内株式市況は、米国新政権の政策動向や欧州の選挙などが波乱要因と考えられますが、堅調な内外の経済指標や米国の景気刺激政策への期待などから、中期的な上昇基調は継続すると想定しています。株式組入比率（株式先物、Ｊリートを含む。）は90%程度以上の高位を維持する方針です。銘柄の選定にあたっては、業績動向やＰＥＲ（株価収益率）、ＰＢＲ（株価純資産倍率）などのバリュエーション指標、株主還元や資本効率の向上に対する経営姿勢などに注目してまいります。

◆ポートフォリオについて

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

株式組入比率（株式先物、Ｊリートを含む。）は、おおむね90～97%程度としました。

業種構成は、化学、非鉄金属、電気機器などの組入比率を引き上げる一方、情報・通信業、銀行業、保険業などの組入比率を引き下げました。期末では、化学、卸売業、輸送用機器、非鉄金属などを中心としたポートフォリオとしました。

個別銘柄では、業績見通しやバリュエーションの割安感、配当利回りの高さなどから東京エレクトロンや昭和電工などを買い付けました。一方で、業績見通しの相対感や配当利回りの水準、バリュエーションの割安感が薄れてきたことなどから日本電信電話やＳＵＭＣＯなどを売却しました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

ＴＯＰＩＸの騰落率を上回った非鉄金属をオーバーウエートとしていたことや、ＴＯＰＩＸの騰落率を下回った小売業、医薬品をアンダーウエートとしていたことなどがプラス要因となりましたが、ＴＯＰＩＸの騰落率を下回った保険業をオーバーウエートとしていたことや、ＴＯＰＩＸの騰落率を上回った電気機器をアンダーウエートとしていたことなどはマイナス要因となりました。個別銘柄では、三井金属、昭和電工、三菱自動車工業などはプラスに寄与しましたが、ＳＵＭＣＯ、三菱商事、ＭＳ＆ＡＤなどがマイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

国内株式市況は、グローバル景気の改善や内外金利差の拡大期待から企業業績の改善が継続することで、中期的な上昇基調は継続すると想定しています。株式組入比率（株式先物、Ｊリートを含む。）は90%程度以上の高位を維持する方針です。銘柄の選定にあたっては、業績動向やＰＥＲおよびＰＢＲなどのバリュエーション指標、株主還元や資本効率の向上に対する経営姿勢などに注目してまいります。

■1万口当りの費用の明細

項　目	当　期
売買委託手数料	27円
(株式)	(27)
(先物)	(0)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	—
その他費用	—
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は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株　式

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

	買		売	
	株　数	金　額	株　数	金　額
	千株	千円	千株	千円
国内	4,793 (△3,739.5)	8,404,677 (−)	20,106.7	22,998,910

(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

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

	買		売	
	口　数	金　額	口　数	金　額
	千口	千円	千口	千円
国内	−	−	0.25 (−)	70,765 (−)

(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。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

種　類　別		買　建		売　建	
		新規買付額	決　済　額	新規売付額	決　済　額
国内	株式先物取引	百万円 1,544	百万円 639	百万円 −	百万円 −

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株　式

(2017年4月18日から2017年10月16日まで)

当　期							
買　付				売　付			
銘　柄	株　数	金　額	平均単価	銘　柄	株　数	金　額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
東京エレクトロン	42.5	688,199	16,192	日本電信電話	167.5	876,615	5,233
昭和電工	185	479,319	2,590	三菱ＵＦＪフィナンシャルG	850	583,942	686
ディスコ	18	334,592	18,588	あおぞら銀行	1,020	503,184	493
キヤノン	75	272,064	3,627	本田技研	155	485,872	3,134
任天堂	7	269,315	38,473	日産自動車	385	423,407	1,099
日立ハイテクノロジーズ	56	240,966	4,302	ＮＴＴドコモ	155	403,143	2,600
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	260	223,325	858	三井物産	245	383,433	1,565
マツダ	130	219,611	1,689	三井住友フィナンシャルG	90	375,862	4,176
三井住友トラストＨＤ	50	192,907	3,858	Ｔ&Dホールディングス	235	373,480	1,589
住友鉱山	115	188,388	1,638	りそなホールディングス	625	364,858	583

(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	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
鉱業（0.2%）			
三井松島	50	35	47,950
建設業（2.5%）			
ミライト・ホールディングス	30	－	－
日成ビルド工業	240	－	－
大和ハウス	132.5	117.5	477,520
協和エクシオ	50	15	36,600
九電工	17.5	－	－
日揮	110	－	－
食料品（0.2%）			
日本たばこ産業	60	10	37,820
繊維製品（0.4%）			
シキボウ	600	－	－
東レ	－	80	86,280
化学（11.6%）			
昭和電工	－	120	431,400
住友化学	475	370	259,000
東亞合成	－	60	88,740
デンカ	340	42.5	158,737
信越化学	40	32.5	331,012
三井化学	550	42.5	140,037
ＪＳＲ	－	35	72,415
三菱ケミカルＨＬＤＧＳ	－	200	226,000
住友ベークライト	－	105	91,245
宇部興産	300	47.5	155,087
花王	－	20	141,200
大日本塗料	450	15	24,555
日本特殊塗料	40	22.5	43,447
ＤＩＣ	30	－	－
ポーラ・オルビスＨＤ	50	30	110,100
日本農薬	150	－	－
天馬	72.5	－	－
パーカーコーポレーション	390	220	152,020
医薬品（1.1%）			
武田薬品	30	5	31,060
エーザイ	10	－	－
小野薬品	－	15	39,255
沢井製薬	－	25	164,500
大塚ホールディングス	5	－	－
石油・石炭製品（1.3%）			
ＪＸＴＧホールディングス	959.5	290	165,039
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	135	40	101,400
ゴム製品（0.9%）			
ブリヂストン	65	35	185,745
ガラス・土石製品（4.4%）			
神島化学	110	－	－
旭硝子	180	35	149,975
太平洋セメント	950	20	86,800
ノザワ	170	95	137,750
東海カーボン	－	100	109,700
日本碍子	65	－	－
品川リフラクトリーズ	350	30	111,150
黒崎播磨	300	19	100,510
フジミインコーポレーテッド	60	40	102,120
ニチアス	170	85	116,195
鉄鋼（1.2%）			
ＪＦＥホールディングス	50	－	－
山陽特殊製鋼	255	－	－
日立金属	150	100	157,300
新日本電工	400	230	103,270
非鉄金属（10.5%）			
日本軽金属ＨＤ	1,350	700	240,100
三井金属	1,070	80	470,400
東邦亜鉛	570	37.5	199,500
三菱マテリアル	40	40	160,600
住友鉱山	330	125	496,750
ＤＯＷＡホールディングス	100	12	53,580
古河機金	725	－	－
ＵＡＣＪ	500	45	146,925
古河電工	40	31	203,050
住友電工	110	120	219,360
金属製品（－）			
ケー・エフ・シー	47.8	－	－
ＳＵＭＣＯ	175	－	－
東京製綱	85	－	－
機械（5.8%）			
東芝機械	250	215	141,470
アイダエンジニア	－	112.5	146,587
旭ダイヤモンド	－	22.5	23,625
ＤＭＧ森精機	140	92.5	201,372
ディスコ	－	12	286,080
日進工具	45	－	－
三井海洋開発	75	－	－
三精テクノロジーズ	75	90	85,140
荏原製作所	25	－	－
北越工業	100	－	－
加藤製作所	20	－	－
タダノ	80	－	－
キトー	160	75	105,075
アマノ	－	17.5	47,022
ツバキ・ナカシマ	100	－	－
日本精工	225	110	165,330
日本ピラー工業	115	－	－
電気機器（9.5%）			
三菱電機	150	180	335,340
日本電産	－	10	142,350
愛知電機	45	37.5	131,812
富士通	－	120	107,832
セイコーエプソン	－	22.5	62,100
アルバック	－	12.5	89,625
ホーチキ	65	－	－
日立国際電気	80	－	－
マクセルホールディングス	－	65	168,935
ユニデンホールディングス	－	170	51,340
レーザーテック	100	57.5	135,355
カシオ	25	－	－
村田製作所	19.5	13.5	229,095
東京エレクトロン	－	30	538,800
輸送用機器（10.7%）			
デンソー	60	47.5	269,467
東海理化電機	－	25	57,800
ニチユ三菱フォークリフト	115	－	－
三菱ロジスネクスト	－	20	17,600
日産自動車	490	140	151,620
いすゞ自動車	70	30	46,470
トヨタ自動車	130	77.5	533,277
三菱自動車工業	800	685	621,980
マツダ	－	100	160,750
本田技研	220	65	221,000
ＳＵＢＡＲＵ	57.5	40	158,520
精密機器（0.9%）			
東京精密	30	27.5	109,175
ニプロ	－	50	81,950
その他製品（3.2%）			
バンダイナムコＨＬＤＧＳ	45	42.5	163,412
桑山	60	33.4	20,407
ＮＩＳＳＨＡ	－	10	33,350
任天堂	8	10	443,100
電気・ガス業（－）			
電源開発	30	－	－
陸運業（0.3%）			
西日本旅客鉄道	12	－	－
西武ホールディングス	－	30	59,280
海運業（－）			
ＮＳユナイテッド海運	350	－	－
空運業（－）			
日本航空	100	－	－
情報・通信業（3.2%）			
システナ	10	－	－
三菱総合研究所	15	－	－
ＳＲＡホールディングス	32.5	－	－
トレンドマイクロ	－	15	87,450
日本電信電話	170	5	26,285
ＮＴＴドコモ	195	40	104,800
ソフトバンクグループ	55	45	449,235
卸売業（11.5%）			
アルコニックス	110	50	90,350
萩原電気	45	30	100,800
伊藤忠	490	335	626,785
丸紅	350	－	－

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三井物産	375	180	297,450
日立ハイテクノロジーズ	−	26	114,920
住友商事	320	160	257,280
三菱商事	340	210	544,845
伊藤忠エネクス	165	80	98,240
日鉄住金物産	30	27.5	163,900
東テク	127.5	52.5	106,522
小売業（0.6%）			
パルグループＨＬＤＧＳ	−	12.5	38,750
ＬＩＸＩＬビバ	13.3	−	−
ファーストリテイリング	−	2.5	90,325
銀行業（9.5%）			
あおぞら銀行	1,400	20	87,100
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	1,900	1,150	842,605
りそなホールディングス	750	125	73,387
三井住友トラストＨＤ	−	20	84,420
三井住友フィナンシャルＧ	250	160	703,520
セブン銀行	360	100	41,500
みずほフィナンシャルＧ	1,750	800	160,400
証券、商品先物取引業（1.0%）			
野村ホールディングス	650	325	213,882
保険業（5.1%）			
ＳＯＭＰＯホールディングス	90	50	212,750
ＭＳ＆ＡＤ	132.5	85	307,700
第一生命ＨＬＤＧＳ	190	90	186,570
東京海上ＨＤ	100	50	231,600
Ｔ＆Ｄホールディングス	280	80	132,920
その他金融業（2.1%）			
日立キャピタル	37.5	20	57,460
オリックス	225	145	277,312
三菱ＵＦＪリース	375	180	111,420
不動産業（−）			
アーバネットコーポレーション	160	−	−
サムティ	180	−	−
ユニゾホールディングス	42.5	−	−
東急不動産ＨＤ	150	−	−
住友不動産	110	−	−
トーセイ	100	−	−
サンフロンティア不動産	120	−	−
サービス業（2.2%）			
トラスト・テック	90	12.5	40,625
ＧＣＡ	140	30	30,210
アウトソーシング	−	25	37,775
ディー・エヌ・エー	80	42.5	106,632
電通	−	20	102,400
日本ハウズイング	9.8	9.8	29,939
テクノプロ・ホールディング	50	10	51,000
ソラスト	−	25	54,800
	千株	千株	千円
合計 株数、金額	30,772.4	11,719.2	20,882,514
合計 銘柄数<比率>	133銘柄	122銘柄	<92.7%>

（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) 国内投資信託証券

銘柄		期首	当期末	
		口数	口数	評価額
		千口	千口	千円
MCUBS MidCity投資法人		0.05	−	−
大和ハウスリート投資法人		0.2	−	−
合計	口数、金額	0.25	−	−
	銘柄数<比率>	2銘柄	−	<−>

(3) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
国内	ＴＯＰＩＸ	947	−

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年10月16日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	20,882,514	91.1
コール・ローン等、その他	2,047,945	8.9
投資信託財産総額	22,930,460	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10月16日現在

項目	当期末
(A) 資産	**22,886,835,225円**
コール・ローン等	1,138,981,553
株式(評価額)	20,882,514,900
未収入金	674,770,821
未収配当金	209,442,950
その他未収収益	1
差入委託証拠金	△ 18,875,000
(B) 負債	**353,807,558**
未払金	223,879,558
未払解約金	129,928,000
(C) 純資産総額(A－B)	**22,533,027,667**
元本	7,768,506,867
次期繰越損益金	14,764,520,800
(D) 受益権総口数	**7,768,506,867口**
1万口当り基準価額(C／D)	**29,006円**

＊期首における元本額は13,617,223,397円、当期中における追加設定元本額は249,639,191円、同解約元本額は6,098,355,721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、ダイワ好配当日本株投信（季節点描）6,211,543,275円、ダイワ・バランス３資産（外債・海外リート・好配当日本株）32,512,586円、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）36,154,311円、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）32,661,954円、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）614,745,758円、ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド105,077,959円、ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）107,125,517円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）102,038,436円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）205,255,796円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）321,391,275円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は29,006円です。

■損益の状況

当期　自2017年４月18日　至2017年10月16日

項目	当期
(A) 配当等収益	**318,736,483円**
受取配当金	291,916,650
その他収益金	27,255,335
支払利息	△ 435,502
(B) 有価証券売買損益	**5,041,197,253**
売買益	5,365,029,922
売買損	△ 323,832,669
(C) 先物取引等損益	**42,117,100**
取引益	50,109,500
取引損	△ 7,992,400
(D) その他費用	**△ 3,356**
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	**5,402,047,480**
(F) 前期繰越損益金	**19,233,027,097**
(G) 解約差損益金	**△10,279,476,586**
(H) 追加信託差損益金	**408,922,809**
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	**14,764,520,800**
次期繰越損益金(I)	**14,764,520,800**

（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。