

★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／インデックス型	
信託期間	無期限	
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	ベビーファンド ※標準組入比率を めどに組み入れ ます。	トピックス・インデックス・マザー ファンド、日本債券インデックスマ ザーファンド、外国株式インデックス マザーファンドおよび外国債券イン デックスマザーファンドの受益証券
	トピックス・インデックス・ マザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式（上場 予定を含みます。）
	日本債券インデックス マザーファンド	わが国の公社債
	外国株式インデックス マザーファンド	外国の株式（預託証券を含みます。）
	外国債券インデックス マザーファンド	外国の公社債
ベビーファンド の運用方法	①主として、各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。 ②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。ただし、市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。 トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券… 信託財産の純資産総額の20％ 日本債券インデックスマザーファンド受益証券…………… 信託財産の純資産総額の65％ 外国株式インデックスマザーファンド受益証券…………… 信託財産の純資産総額の 5 ％ 外国債券インデックスマザーファンド受益証券…………… 信託財産の純資産総額の10％ また、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ③保有実質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。 ④保有実質外貨建資産とは、信託財産にかかる保有外貨建資産および各マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした資産との合計をいいます。	
	ベビーファンドの 株式実質投資比率	純資産総額の50％以下
組入制限	トピックス・インデックス・ マザーファンドの株式上限比率	無制限
	日本債券インデックス マザーファンドの株式上限比率	純資産総額の30％以下
	外国株式インデックス マザーファンドの株式上限比率	無制限
	外国債券インデックス マザーファンドの株式上限比率	純資産総額の30％以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配します。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。

ダイワライフスタイル25

運用報告書（全体版）

第17期

（決算日 2016年11月30日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワライフスタイル25」は、このたび、第17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/>

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	合成ベンチマーク		株 式 組入比率	株式先物 比	公 社 債 組入比率	債券先物 比	投資信託 証券 組入比率	純 資 産 額
		税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率						
	円	円	%	(ベンチマーク)	%	%	%	%	百万円
13期末 (2012年11月30日)	10,771	0	5.7	11,380	5.9	25.0	0.5	73.4	501
14期末 (2013年12月 2 日)	12,646	0	17.4	13,364	17.4	24.7	0.3	74.0	638
15期末 (2014年12月 1 日)	13,560	0	7.2	14,391	7.7	25.1	0.3	73.5	744
16期末 (2015年11月30日)	13,947	0	2.9	14,858	3.2	25.1	0.3	73.0	875
17期末 (2016年11月30日)	13,963	0	0.1	14,971	0.8	24.9	0.3	73.3	915

(注 1) 合成ベンチマークは、各マザーファンドごとのベンチマークと標準組入比率をもとに、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。

(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) 先物比率は買建比率－売建比率です。

(注 4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

〈標準組入比率〉

各マザーファンドの受益証券の組入比率は標準組入比率をめどに投資を行なうこととなっております。なお、当ファンドにおける各マザーファンドの受益証券の標準組入比率は、純資産総額に対してそれぞれ以下の通りです。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の受益証券	20%
「日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券	65%
「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券	5%
「外国債券インデックスマザーファンド」の受益証券	10%

《運用経過》

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークは合成ベンチマークです。

■基準価額・騰落率

期 首：13,947円

期 末：13,963円

騰落率：0.1%

■組入ファンドの当期中の騰落率

組入ファンド	騰落率
トピックス・インデックス・マザーファンド	△5.0%
日本債券インデックスマザーファンド	4.2%
外国株式インデックスマザーファンド	△5.2%
外国債券インデックスマザーファンド	△8.0%

■基準価額の主な変動要因

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券に投資した結果、国内株式の下落や為替相場で円高が進行したことが基準価額のマイナス要因となりましたが、国内債券が上昇したことがプラスに寄与し、基準価額はやや上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワライフスタイル 25

年 月 日	基 準 価 額	合 成 ベ ン チ マ ー ク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)					
(期首)2015年11月30日	円 13,947	% －	14,858	% －	% 25.1	% 0.3	% 73.0	% －
12月末	13,902	△0.3	14,816	△0.3	24.8	0.3	73.9	－
2016年 1 月末	13,761	△1.3	14,652	△1.4	23.3	0.5	74.7	－
2 月末	13,541	△2.9	14,468	△2.6	25.2	0.4	73.0	－
3 月末	13,800	△1.1	14,721	△0.9	25.4	0.5	73.0	－
4 月末	13,808	△1.0	14,769	△0.6	25.1	0.4	73.3	－
5 月末	13,935	△0.1	14,894	0.2	25.0	0.4	73.2	－
6 月末	13,620	△2.3	14,565	△2.0	23.7	0.4	74.6	－
7 月末	13,764	△1.3	14,745	△0.8	25.5	0.2	73.2	－
8 月末	13,672	△2.0	14,642	△1.5	25.3	0.2	73.3	－
9 月末	13,636	△2.2	14,606	△1.7	24.3	0.4	74.4	－
10月末	13,760	△1.3	14,742	△0.8	24.7	0.3	73.9	－
(期末)2016年11月30日	13,963	0.1	14,971	0.8	24.9	0.3	73.3	－

(注) 騰落率は期首比。

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、ＥＣＢ（欧州中央銀行）の追加金融緩和策への失望や原油価格の下落、中国・人民元安、円高などにより下落しました。2016年1月末には日銀がマイナス金利を導入し一時的に株価は上昇しましたが、その後は、米国経済および中国経済への懸念や欧州金融機関の信用不安などで下落しました。2月後半からは、米国の製造業関連指標の回復や中国およびＥＣＢの金融緩和などで株価は反発しましたが、3月後半からは、日米金融政策や米国為替政策への思惑から為替相場が不安定になり、株価も乱高下しました。6月は、英国の国民投票でＥＵ（欧州連合）離脱支持派が多数だったことを受けて株価は下落しましたが、7月は、国内の財政・金融政策への期待や円高傾向の一服などから、上昇しました。8月以降は、日米の金融政策や米国大統領選挙に関し見方が交錯し、株価は一進一退で推移しました。11月は、米国大統領選挙でのトランプ氏勝利を受けて、一時的に投資家のリスク回避姿勢が強まり株価も下落しましたが、すぐにトランプ氏の景気刺激政策への期待が高まり、株価は上昇に転じました。

○国内債券市況

国内長期金利は、2016年1月下旬に日銀がマイナス金利政策を導入したことを受け、2月にかけて大きく低下しました。その後、市場の追加金融緩和観測が根強かったことや、英国の国民投票でＥＵ離脱派が勝利し金融市場全般にリスク回避の動きが広がったことから、長期金利は一段と低下しました。7月末には、日銀はＥＴＦ（上場投資信託）の買い入れの増額を主体とする金融緩和の強化を実施した上で、次回会合で経済・物価動向や政策効果について総括的な検証を行なうことを発表しました。しかし、金融緩和の強化が市場の期待を下回る規模であったほか、総括的な検証が日銀の金融緩和姿勢の後退につながる恐れがあるとの警戒感も高まったことから、国内長期金利は8月上旬にかけて急上昇した後、横ばいから上昇基調で推移しました。また11月は、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことと、今後の財政拡大などが意識された米国国債安に連れて、国内長期金利は一段と上昇しました。

○外国株式市況

米国・欧州を中心とする外国株式市況は、2016年1月に中国株式市場におけるサーキットブレーカー制度（現物株の取引を一時停止する制度）の発動による混乱、サウジアラビアとイランの国交断絶などによる地政学リスクの高まりなどを背景に大幅に下落しましたが、2月中旬以降は、産油国の生産量維持に関する合意による原油価格の反発や、米国経済指標の改善などを受けて反発しました。3月以降は、ＥＣＢによる追加金融緩和の発表やＦＯＭＣ（米国連邦公開市場委員会）での利上げ見送りなどが好感され堅調に推移しましたが、6月下旬の英国の国民投票でＥＵ離脱派が多数となると欧州情勢への懸念が高まり、世界的なリスク回避の動きの中で一時急落しました。その後は、英国および各国の中央銀行が政策協調を表明したことが好感されて反発し、米国企業の良好な決算内容などを受けて上昇基調となりましたが、米国の利上げ観測に影響されて一進一退の展開が続き、期を通じてはやや上昇して期末を迎えました。

○外国債券市況

外国債券市況は、2016年の年明け以降、原油価格や人民元の下落を背景に株式市場の調整が強まったことや、1月末に日銀が予想外のマイナス金利を導入した影響もあり、金利は大きく低下しました。2月中旬から5月ごろにかけては、金利は上下動しながらもおおむねレンジ内での動きにとどまりまし

た。その後、米国の早期利上げ観測が後退したことや、英国のEU離脱を問う国民投票でEU離脱派が勝利し市場のリスク回避姿勢が強まったことから、金利低下圧力が強まりました。7月に各国金利は反発し上昇しましたが、8月にはBOE（イングランド銀行）から市場予想以上の金融緩和策が発表され、英国国債金利は低下しました。9月以降は、ECBの資産買い入れの減額観測が出たことやBOEの追加緩和観測が後退したことなどを受けて、金利は上昇しました。また、11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利し今後の財政拡大などが意識されたことも、さらなる金利上昇の要因となりました。

○為替相場

為替相場は、2016年の年明け以降、リスク回避傾向が強まり円高で推移しました。3月には、原油価格が底打ちの様相となってオーストラリア・ドルやカナダ・ドルなどの資源国通貨が買い戻されました。4月以降は、日銀の主要な金融政策において追加緩和が見送られたことなどから、再び円高が進行しました。その後は、米国の早期利上げ観測の後退や英国の国民投票の結果を受けたリスク回避姿勢の動きから、さらに円高傾向での推移となりました。7月に入るといったんは円安となりましたが、日銀の金融政策決定会合で政策金利が据え置かれたことが市場の失望を誘い、再び円高が進行しました。10月には、原油価格が上昇したことや欧州の一部の銀行に対する信用不安が和らいだことなどを受けて円安になりました。11月は、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことで金利が上昇し、大きく円高が進みました。

前期における「今後の運用方針」

○当ファンド

4本のマザーファンドの受益証券をあらかじめ定められた標準組入比率をめぐりに組み入れることにより、信託財産の中長期的な成長をめざした運用を行なっておりま。

○トピックス・インデックス・マザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマーク（TOPIX）に連動する投資成果をめざして運用を行なっておりま。

○日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマーク（ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数）との高い連動性を維持するような運用を行ないま。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）の変動に対する感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コスト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う方針です。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

○外国株式インデックスマザーファンド

今後の運用にあたりましても、ベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ベース））の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なっておりま。

○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（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。

ポートフォリオについて

○当ファンド

4種類（トピックス・日本債券・外国株式・外国債券）の各インデックスマザーファンドの受益証券を規定の標準組入比率（トピックス：20%、日本債券：65%、外国株式：5%、外国債券：10%）に応じて組み入れ、各マザーファンドの受益証券の合計組入比率がおおむね100%程度となるように運用いたしました。

○トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

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

○日本債券インデックスマザーファンド

当ファンドの騰落率が、ベンチマーク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。

○外国株式インデックスマザーファンド

外国株式を中心に、S & P 500先物取引も一部利用し、株式組入比率（リート、株式先物を含む。）につきましては、期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

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

○外国債券インデックスマザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（合成ベンチマーク）の騰落率は0.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.1%となりました。

ファンドで組み入れている各マザーファンドの騰落率とそれに対応する各ベンチマークの騰落率との差異、各マザーファンドの組入比率とファンドの標準組入比率とのズレ、信託報酬等のコストがかい離の要因としてあげられます。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2015年12月1日 ～2016年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	4,387

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

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

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

《今後の運用方針》

○当ファンド

引き続き、4本のマザーファンドの受益証券をあらかじめ定められた標準組入比率をめぐりに組み入れることにより、信託財産の中長期的な成長をめざした運用を行なってまいります。

○トピックス・インデックス・マザーファンド

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

○日本債券インデックスマザーファンド

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

○外国株式インデックスマザーファンド

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

○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。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当期		項 目 の 概 要
	(2015.12.1～2016.11.30)		
	金 額	比 率	
信託報酬	104円	0.756%	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13,714円です。
(投信会社)	(40)	(0.292)	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)	(52)	(0.378)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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)	(12)	(0.086)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0.001	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.000	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)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	2	0.014	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)	(1)	(0.006)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・ 資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	106	0.771	

(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

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	60,875	48,445	43,986	36,124
日本債券インデックスマザーファンド	39,787	56,028	38,457	53,418
外国株式インデックスマザーファンド	6,450	11,414	4,227	7,667
外国債券インデックスマザーファンド	6,673	17,634	1,743	4,566

(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

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

項 目	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	13,800,351千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	116,475,808千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.11
	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	8,034,400千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	69,861,812千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	B／A	C	うち利害関係人との取引状況D	D／C
株式	百万円 8,288	百万円 3,220	% 38.8	百万円 5,511	百万円 —	% —
株式先物取引	14,742	—	—	14,699	—	—
コール・ローン	723,963	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.2%

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

(3) 日本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

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	B／A	C	うち利害関係人との取引状況D	D／C
公社債	百万円 10,036	百万円 686	% 6.8	百万円 13,522	百万円 1,749	% 12.9
コール・ローン	51,668	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合1.1%

(4) 外国株式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。

(5) 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。

(6) 利害関係人の発行する有価証券等

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

種 類	当 期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株式	百万円 16	百万円 0	百万円 371

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(7) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期	期 末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	190,099	206,988	184,985
日本債券インデックスマザーファンド	419,178	420,509	589,049
外国株式インデックスマザーファンド	21,679	23,902	46,583
外国債券インデックスマザーファンド	30,209	35,139	92,292

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

項 目	当 期	期 末
	評 価 額	比 率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	184,985	20.0
日本債券インデックスマザーファンド	589,049	63.8
外国株式インデックスマザーファンド	46,583	5.0
外国債券インデックスマザーファンド	92,292	10.0
コール・ローン等、その他	10,041	1.2
投資信託財産総額	922,952	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＝112.42円、1 カナダ・ドル＝83.68円、1 オーストラリア・ドル＝84.14円、1 香港ドル＝14.50円、1 シンガポール・ドル＝78.97円、1 ニュージーランド・ドル＝80.25円、1 イギリス・ポンド＝140.46円、1 イスラエル・シェケル＝29.32円、1 スイス・フラン＝111.11円、1 デンマーク・クローネ＝16.09円、1 ノルウェー・クローネ＝13.18円、1 スウェーデン・クローネ＝12.25円、1 メキシコ・ペソ＝5.45円、1 マレーシア・リンギット＝25.18円、1 南アフリカ・ランド＝8.10円、1 ポーランド・ズロチ＝26.99円、1 ユーロ＝119.70円です。
- (注3) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (78,796,718千円) の投資信託財産総額 (79,630,991千円) に対する比率は、99.0%です。
- 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (153,945,576千円) の投資信託財産総額 (155,316,251千円) 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

2016年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	922,952,952円
コール・ローン等	9,976,242
トピックス・インデックス・マザーファンド(評価額)	184,985,920
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	589,049,038
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	46,583,825
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	92,292,927
未収入金	65,000
(B) 負債	7,396,371
未払解約金	3,978,578
未払信託報酬	3,381,663
その他未払費用	36,130
(C) 純資産総額(A－B)	915,556,581
元本	655,709,430
次期繰越損益金	259,847,151
(D) 受益権総口数	655,709,430口
1万口当り基準価額(C／D)	13,963円

- * 期首における元本額は627,825,361円、当期中における追加設定元本額は91,543,767円、同解約元本額は63,659,698円です。
- * 当期末の計算口数当りの純資産額は13,963円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月1日 至2016年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 829円
受取利息	454
支払利息	△ 1,283
(B) 有価証券売買損益	9,545,446
売買益	24,092,875
売買損	△ 14,547,429
(C) 信託報酬等	△ 6,746,853
(D) 当期損益金(A + B + C)	2,797,764
(E) 前期繰越損益金	129,053,383
(F) 追加信託差損益金	127,996,004
(配当等相当額)	(155,845,513)
(売買損益相当額)	(△ 27,849,509)
(G) 合計(D + E + F)	259,847,151
次期繰越損益金(G)	259,847,151
追加信託差損益金	127,996,004
(配当等相当額)	(155,845,513)
(売買損益相当額)	(△ 27,849,509)
分配準備積立金	131,851,976
繰越損益金	△ 829

- (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12ページの「収益分配金の計算過程 (総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	2,798,593
(c) 収益調整金	155,845,513
(d) 分配準備積立金	129,053,383
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	287,697,489
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	287,697,489
(h) 受益権総口数	655,709,430口

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

《お知らせ》
●投資信託証券への投資制限の変更
当ファンドおよび当ファンドが主要投資対象とする外国株式インデックスマザーファンドにおいて、投資信託証券への投資比率の上限を純資産総額の5%としていますが、上場投資信託については、この制限の適用除外とし、5%を超えて投資できることとする変更を行ないました。

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワライフスタイル２５）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2016年9月20日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年11月30日）現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を13～18ページに併せて掲載いたしました。

■トピックス・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

買				付				売				付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
日本郵政	184.2	328,647	1,784	ソフトバンクグループ	69.2	458,977	6,632	トヨタ自動車	37.08	245,831	6,629	トヨタ自動車	37.08	245,831	6,629
ゆうちょ銀行	169.2	270,225	1,597	三菱UFJフィナンシャルG	278	151,468	544	日産自動車	108.7	113,006	1,039	日産自動車	108.7	113,006	1,039
日本電信電話	39.9	190,130	4,765	東京エレクトロン	12.5	105,478	8,438	日本たばこ産業	24.7	99,580	4,031	日本たばこ産業	24.7	99,580	4,031
九州旅客鉄道	27.5	164,677	5,988	アステラス製薬	52.4	84,522	1,613	富士フイルムHLDGS	18.7	73,950	3,954	富士フイルムHLDGS	18.7	73,950	3,954
東日本旅客鉄道	12.6	121,035	9,605	東海旅客鉄道	4	71,489	17,872	武田薬品	14.5	69,327	4,781	武田薬品	14.5	69,327	4,781
三菱UFJフィナンシャルG	181	92,890	513												
デンソー	20.9	92,877	4,443												
日本電産	9.6	90,069	9,382												
KDDI	26.5	81,365	3,070												

(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、2016年11月30日現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンド（141,237,185千口）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	株数	金額	銘柄	株数	金額	銘柄	株数	金額	銘柄	株数	金額
水産・農林業 (0.1%)	千株	千円	鹿島建設	千株	千円	住友林業	千株	千円	千代田化工建	千株	千円
極洋	3.2	8,649	不動テトラ	57.6	12,268	日本基礎技術	44.7	69,955	新興プランテック	46	37,766
日本水産	85.5	43,947	鉄建建設	43	15,093	日成ビルド工業	21	11,298	食料品 (4.5%)	14.8	11,943
マルハニチロ	12.4	36,084	西松建設	76	42,712	パナホーム	24	19,488	日本製粉	19.1	29,528
カナコ種苗	3.9	5,709	三井住友建設	253	32,131	大和ハウス	193.1	627,961	日清製粉G本社	71.3	114,293
サカタのタネ	9.7	29,041	大豊建設	25	14,350	ライト工業	12.8	16,256	昭和産業	26	15,288
ホクト	6.6	13,259	前田建設	40	42,600	積水ハウス	204.8	382,976	中部飼料	8.4	8,685
鉱業 (0.3%)			奥村組	52	34,632	ユアテック	11	8,536	フィード・ワン	48.3	7,341
日鉄鉱業	2	10,460	東鉄工業	8	24,320	西部電気工業	3.2	6,611	日本甜菜糖	4.1	9,122
三井鉱山	6.2	8,208	浅沼組	25	8,525	中電工	7.8	17,979	三井製糖	4.5	10,687
国際石油開発帝石	344.7	373,999	戸田建設	76	48,716	関電工	26	27,690	塩水港精糖	22.7	5,493
日本海洋堀削	2.6	6,175	熊谷組	104	30,576	きんでん	43	62,049	日新製糖	3.4	5,443
石油資源開発	10	23,270	北野建設	27	8,424	東京エネシス	7	6,671	森永製菓	12.9	58,372
K&Oエナジーグループ	4.7	7,994	三井ホーム	12	5,592	トーエネック	10	5,330	中村屋	2.1	10,017
建設業 (3.1%)			矢作建設	9.7	9,603	住友電設	4.8	5,860	江崎グリコ	16.4	87,740
ショーボンドHD	6.8	34,884	ピーエス三菱	16.1	5,940	日本電設工業	10.6	19,599	不二家	39	8,385
ミライト・ホールディングス	20.3	22,228	日本ハウスHLDGS	18.4	7,636	協和エクシオ	25.4	41,097	山崎製パン	48	108,912
タマホーム	10.1	5,534	大東建託	24	426,600	九電工	12.8	41,088	モロゾフ	19	8,664
安藤・間	47.4	38,062	新日本建設	8.2	7,929	三機工業	14.7	14,097	亀田製菓	3.8	19,950
東急建設	23.7	22,230	NIPPO	14	30,646	日揮	60.6	114,412	寿スピリッツ	5	13,160
コムシスホールディングス	25.2	49,266	東亜道路	25	7,925	中外炉工業	30	6,240	カルビー	26.7	95,185
ミサワホーム	8.9	8,980	前田道路	20	39,360	太平電業	9	9,981	森永乳業	59	46,256
高松コンストラクションGP	4.9	12,441	日本道路	21	9,261	高砂熱学	17.9	27,297	六甲バター	3.2	8,102
東建コーポレーション	2.7	21,384	東亜建設	5.5	10,483	明星工業	13.5	7,411	ヤクルト	35.1	176,202
大成建設	333	275,724	若築建設	57	9,291	大気社	8.5	23,987	明治ホールディングス	38.8	353,856
大林組	196.3	213,574	東洋建設	21.1	8,714	ダイダ	10	9,400	雪印メグミルク	14.2	45,440
清水建設	201	211,854	五洋建設	72.4	40,616	日比谷総合設備	7.6	12,479	プリマハム	42	16,716
飛鳥建設	68.9	13,366	大林道路	8.1	5,718	東芝プラントシステム	10.4	17,825	日本ハム	44	129,624
長谷工コーポレーション	76.2	90,220	世紀東急	14.3	7,293	OSJBHD	24.2	5,783	丸大食品	32	15,104
松井建設	8.2	9,052	福田組	11	12,716	東洋エンジニア	38	12,160	S Foods	3.7	10,001

銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額
2016年11月30日現在	千株	千円	2016年11月30日現在	千株	千円	2016年11月30日現在	千株	千円	2016年11月30日現在	千株	千円
伊藤ハム米久HLDGS	38.3	38,223	化学 (6.4%)			中国塗料	17.6	13,710	キッセイ薬品工業	10.5	28,192
サッポロホールディングス	21.1	63,511	クラレ	101.3	163,903	日本特殊塗料	5	6,915	生化学工業	11.4	18,661
アサヒグループホールディングス	122.6	456,317	旭化成	381	387,667	藤倉化成	11.1	6,804	栄研化学	5.1	15,254
キリンHD	281.7	524,947	共栄レザー	6.2	4,929	太陽ホールディングス	4.8	21,264	日本製薬	4.5	5,400
宝ホールディングス	46.9	48,822	昭和電工	40	61,760	D I C	23.7	83,779	鳥居薬品	4.3	10,238
オエノンホールディングス	29	7,453	昭友化学	447	233,781	サカタインクス	12.2	18,275	J C R ファーマ	4.9	14,014
コカ・コーラウエスト	22.1	71,604	住友化成	49	7,350	東洋キヤンセルホールディングス	55	28,600	東和薬品	2.9	11,962
コカ・コーライストジャパン	25.5	61,633	住友精化	2.6	11,206	T & K T O K A	6.3	6,079	富士製薬工業	2.3	6,072
サントリー食品インター	44.9	219,785	日産化学	33.3	126,706	富士フイルムHLDGS	120.8	513,279	沢井製薬	10.2	62,526
ダイドードリンコ	2.9	16,385	ラサ工業	62	8,122	資生堂	116	337,444	ゼリア新薬工業	12.5	23,212
伊藤園	19.4	73,332	クレハ	4.5	21,015	ライオン	76	141,360	第一三共	179.6	427,807
キーコーヒー	6.3	13,154	テイカ	11	6,787	高砂香料	41	12,669	キョーリン製薬HD	14.4	34,588
日清オイリオグループ	37	18,019	石原産業	11.8	11,304	マンダム	6.2	30,442	大幸薬品	4.1	7,703
不二製油グループ	17.4	37,549	日東工フシー	5.9	5,245	ミルボン	3.5	16,240	ダイト	3.9	7,807
ジョーイルミルズ	3.1	11,563	日本曹達	36	17,856	ファンケル	13.2	20,869	大塚ホールディングス	131.3	610,151
キーコマン	46	161,000	東ソー	176	135,168	コーセー	10	91,700	大正製薬HD	13	126,880
味の素	134.6	297,802	トクヤマ	95	42,655	シーズ・ホールディングス	8	23,680	ペプチドーム	10.4	59,280
キューピー	33.5	90,550	セントラル硝子	62	28,024	ボラー・オルビスHD	6.3	55,881	石油・石炭製品 (0.5%)		
ハウス食品G本社	23.9	54,826	東亜合成	36.4	40,294	ノビアホールディングス	3.9	13,962	日本コークス工業	66.9	6,690
カゴメ	23.4	62,875	大阪ソーダ	27	12,690	コニシ	9.9	12,642	昭和シェル石油	54.3	55,440
アリアケジャパン	5.4	30,888	関東電機	13	12,350	長谷川香料	7.6	14,774	ニチレキ	9.4	8,507
ニチレイ	32.3	74,774	デンカ	124	62,620	星光PMC	4.2	5,065	東燃ゼネラル石油	98	106,722
東洋水産	31.9	129,195	信越化学	109.5	926,370	小林製薬	17.1	85,671	ユシロ化学	4.8	6,720
日清食品HD	25.5	151,980	日本カーバイド	51	7,599	荒川化学工業	5.5	8,706	富士石油	16.7	5,377
永谷園ホールディングス	7	9,380	堺化学	22	7,876	メック	5.6	5,549	MORESCO	3.8	6,194
フジッコ	6.6	15,457	エフ・ウォーター	49.7	97,163	日本高純度化学	3.8	9,598	出光興産	28.7	74,275
ロップフィールド	7.6	10,928	太陽日酸	47	58,844	タカラバイオ	13.2	19,285	J Mホールディングス	672.2	293,348
日本たばこ産業	361.9	1,428,057	日本化学工業	26	6,162	J C U	2.1	10,500	コスモエネルギーHLDGS	18.4	26,680
ケンコーマヨネーズ	2.6	8,372	日本バーカラizing	30.7	40,646	新田ゼラチン	8.5	6,239	ゴム製品 (1.0%)		
わらべや日洋HD	4.1	9,856	高圧ガス	10.4	7,425	デクセリアルズ	15.9	15,423	横浜ゴム	36.7	75,858
ユーグレナ	21.3	27,349	四国化成	9	9,009	アース製薬	4.5	21,375	東洋ゴム	32.4	45,262
ミヨシ油脂	56	7,896	戸田工業	16	4,560	イハラケミカル	9.2	9,540	ブリダストン	206	899,602
理研ビタミン	2	8,870	ステラ ケミファ	3	9,000	北興化学	15	5,565	住友ゴム	56.7	107,106
繊維製品 (0.7%)			保土谷化学	2.4	6,770	大成ラミック	3.4	10,101	藤倉ゴム	10.7	7,104
片倉工業	8.1	10,359	日本触媒	9.5	66,595	クミアイ化学	13.4	9,112	オカモト	19	20,311
グンゼ	44	16,632	大日精化	24	14,568	日本農薬	14.1	8,671	ニッタ	5.4	15,903
東洋紡	240	41,280	カネカ	81	73,791	キレシ	5.9	9,422	住友理工	10.6	10,769
ユニチカ	173	14,878	三菱瓦斯化学	56.3	97,624	有沢製作所	12.8	8,051	ミツ星ベルト	15	15,150
富士紡ホールディングス	3.2	11,408	三井化学	276	146,004	日東電工	44	347,424	バンドー化学	11.4	11,582
倉敷紡績	61	14,091	J S R	60.4	99,418	レック	2.6	8,684	ガラス・土石製品 (0.9%)		
シキボウ	66	9,174	東京応化工業	11.5	43,987	きもと	20.3	5,014	日東紡績	50	22,250
日本毛織	16.8	13,440	大阪有機化学	6.3	5,096	藤森工業	4.7	12,986	旭硝子	300	222,900
ダイドールミテッド	18.8	7,595	三菱ケミカルHLDGS	407	292,836	前澤化成工業	8.5	9,979	日本板硝子	28	22,540
帝国繊維	6.6	10,804	ダイセル	82.4	103,824	ジェイ エス ピー	2.8	7,974	日本山村硝子	34	6,528
帝人	49.1	103,993	住友ベークライト	52	32,084	エフピコ	5.5	31,295	日本電気硝子	125	76,250
東レ	442	410,794	積水化学	138.2	239,362	天馬	4.2	7,799	住友大阪セメント	113	45,652
サカイ オーベックス	2.8	4,970	日本ゼオン	51	52,377	信越ポリマー	13.1	9,995	太平洋セメント	369	132,102
住江織物	22	5,346	アイカ工業	19	57,190	東リ	22.2	8,436	日本ヒューム	8.7	6,107
アツギ	74	8,954	宇部興産	300	71,400	ニフコ	10.5	65,940	日本コンクリート	17.5	6,002
セーレン	15.6	22,869	積水樹脂	9.5	16,473	日本バルカー	5.8	8,653	アジアパイルHD	11.1	5,638
ソート	6.1	7,204	タキロン	15	7,545	ユニ・チャーム	123.9	301,634	東海カーボン	56	21,336
東海染工	53	7,102	旭有機材	33	7,161	協和発酵キリン	73.2	119,462	日本カーボン	36	8,928
小松精練	11.9	7,961	日立化成	33.5	84,085	武田薬品	228.7	1,071,459	東洋炭素	4	6,748
ワコホールディングス	35	46,445	ニチパン	7	5,915	アステラス製薬	623.6	984,976	ノリタケ	3.6	9,316
ホギメディカル	3.9	26,208	リケンテクノス	14.2	7,795	大日本住友製薬	42.9	80,180	TOTO	44.8	196,448
T S Iホールディングス	24.8	16,293	大倉工業	19	9,709	塩野義製薬	82.7	447,407	日本碍子	77.1	168,540
三陽商会	40	6,320	積水化成成品	9	7,209	田辺三菱製薬	71	152,721	日本特殊陶業	52.7	123,634
オンワードホールディングス	38	28,538	群衆化学	1.8	5,400	あすか製薬	7.1	12,048	MA RUWA	2.4	9,564
ゴールドウイン	2.7	13,392	タイガース ポリマー	6.4	4,294	日本新薬	14.1	75,012	品川フランクナリーズ	25	6,325
デサント	14.1	17,667	ダイキョーニシカワ	10.8	15,336	中外製薬	61	196,115	黒崎播磨	18	5,724
パルプ・紙 (0.2%)			日本化薬	39	51,792	科研製薬	11.4	69,312	フジミンコーポレートッド	5.6	11,076
特種東海製紙	3.7	14,781	カーリットホールディングス	13.3	7,102	エーザイ	75.1	496,335	ニチアス	32	35,424
王子ホールディングス	232	108,808	日本精化	8.4	6,879	ロート製薬	29.6	47,833	ニチハ	8.3	23,870
日本製紙	26.5	52,417	扶桑化学工業	4.4	11,184	小野薬品	139.1	352,409	鉄鋼 (1.3%)		
三菱製紙	11.6	8,700	ADEKA	25.1	38,628	久光製薬	17.2	94,600	新日鐵住金	275.1	674,820
北越紙州製紙	32.8	21,516	日油	48	50,832	持田製薬	4.1	32,595	神戸製鋼所	104.3	112,539
中越パルプ	28	6,720	花王	155.3	817,965	参天製薬	112.1	156,491	中山製鋼所	7.8	5,522
巴川製紙	19	4,826	第一工業製薬	19	6,707	扶桑薬品	2.7	7,457	合同製鐵	3.7	8,036
大王製紙	24	30,192	三洋化成	3.5	16,905	日本ケミファ	1.3	6,955	J F Eホールディングス	166.4	277,888
レンゴウ	58.3	39,469	大日本塗料	37	8,029	ツムラ	20.4	63,138	日新製薬	27.4	40,141
トーモク	24	7,680	日本ペイントHOLD	47.2	170,392	日医工	14.2	22,450	東京製鐵	30.6	25,245
ザ・パップ	4.5	11,650	関西ペイント	63.8	133,661				共英製鐵	6.6	13,688

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額
大和工業	12.2	39,650	滝澤鉄工所	54	8,262	グローリー	18.5	69,097	京三製作所	19	7,296
東京鐵鋼	16	7,488	富士機械製造	18.2	23,623	新晃工業	4.8	6,345	能美防炎	6.9	12,413
大阪鐵鋼	4.2	8,757	牧野フリス	30	24,240	大和冷機工業	9.9	8,880	ホーチキ	5.1	7,017
淀川製鋼所	8.3	26,228	オースジー	27.4	61,951	セガサミーホールディングス	57.7	98,667	エレコム	5.4	10,589
東洋鋼板	15.8	5,940	旭ダイヤモンド	17.8	15,023	日本ビストンリング	4.7	8,789	日本無線	4	5,628
丸一鋼管	20.2	74,437	DMG森精機	36	47,592	リケン	3	12,540	パナソニック	665.5	774,642
大同特殊鋼	101	47,369	ソディック	16	14,080	T P R	6.5	20,800	アンリツ	41.3	23,912
日本高周波	89	7,921	ディスコ	7.1	96,276	ツバキ・ナカシマ	6.7	11,242	富士通ゼネラル	20	45,040
日本冶金工	61.3	12,014	日東工器	3.9	9,558	ホシザキ	12.8	124,032	日立国際電気	15.4	35,158
山陽特殊製鋼	36	20,628	O K K	67	7,839	大豊工業	5.2	8,320	ソーニー	411.3	1,352,354
愛知製鋼	3.5	18,480	島精機製作所	8	27,680	日本精工	119.8	149,270	T D K	32.8	252,232
日立金属	61.8	92,391	フレュー	1.4	4,690	NTN	133	57,057	帝国通信工業	32	5,408
大平洋金属	39	14,898	日阪製作所	10	8,150	ジェイテクト	61.7	112,911	ミツミ電機	21.2	14,119
新日本電工	41.2	9,393	やまびこ	11.7	15,678	不二越	57	25,023	タムラ製作所	24	10,584
栗本鉄工所	3.3	7,837	ペガサスミシン製造	8.4	5,485	日本トムソン	20.5	8,815	アルプス電気	53.9	154,854
日本鋳鉄管	25	4,725	ナブテスコ	31.6	91,892	T H K	40.9	100,654	パイオニア	88.3	20,838
三菱製鋼	45	10,215	三井海洋開発	6	10,440	ユージン精機	2.9	7,664	日本電波工業	7.7	6,460
シン・ワッタン	11.4	6,897	レオン自動機	6.6	5,900	イーグル工業	6.5	9,912	日本トリム	1.5	6,405
非鉄金属 (0.9%)			SMC	18.3	595,116	日本ピラー工業	7.3	8,898	ローランド ディー・ジー	3.4	9,781
大紀アルミニウム	15	7,515	新川	7.2	4,888	キッツ	27.7	18,254	フォスター電機	7	14,756
日本軽金属HD	133.6	34,068	ホソカワミクロン	13	8,918	日立工機	14.9	15,585	クラリオン	31	11,532
三井金属	165	43,890	ユニオンツール	2.7	7,630	マキタ	38	294,500	S M K	17	7,293
東邦亜鉛	36	15,804	オニセ工業	7.7	15,908	日立造船	44.3	26,890	ヨコオ	7.1	5,665
三菱マテリアル	37.8	127,953	サトーホールディングス	7.7	17,386	三菱重工業	976	494,636	ホシデン	18.5	17,297
住友鉱山	158	241,424	日精油脂工業	6.2	6,441	I H I	448	142,016	ヒロセ電機	9.4	128,686
DOWAホールディングス	68	59,704	小松製作所	281.7	741,856	スター精密	10	15,560	日本航空電子	18	27,720
岡電機	98	20,286	住友重機械	177	121,953	電気機器 (12.6%)			T O A	8	7,656
大阪チタニウム	7.1	11,431	日立建機	27	63,558	日清紡ホールディングス	31.5	34,902	日立マクセル	8.5	17,042
東邦チタニウム	11	8,360	巴工業	4.9	7,443	イビデン	40.2	62,470	古野電機	8.7	6,933
U A C J	78	25,740	井関農機	63	14,301	ユニカムノルタ	135	147,420	ユニデンホールディングス	40	6,280
古河電工	20.2	71,407	T O W A	5.7	7,643	ブラザー工業	75.5	147,678	アルパイン	14	20,650
住友電工	229.8	368,254	丸山製作所	43	8,299	ミナベア	93.9	106,482	スミダコーポレーション	5.3	5,459
フジクラ	78.9	48,681	北川鉄工所	3.9	8,888	日立	1,397	851,192	アイコム	4	7,840
昭和電線 H L D G S	104	8,840	ロウエー	2.4	3,979	東芝	1,304	554,460	リオン	3.4	5,144
タツタ電線	13.6	6,296	クボタ	293	506,157	三菱電機	621.7	980,110	船井電機	7.2	6,796
リョービ	38	17,366	三菱化工機	34	7,038	富士通	174	97,788	横河電機	62.5	99,062
アールステイ	7.8	8,166	月島機械	11.9	14,875	東洋電機製造	3.6	5,608	新電元工業	23	9,959
アサヒHD	9.2	18,565	帝國機械製作所	6.8	5,909	アズビル	67.1	117,760	アズビル	17.3	53,630
金属製品 (0.7%)			新東工業	14.6	13,461	シンフォニア テクノロジー	44	10,736	日本光電工業	24.2	62,097
稲葉製作所	4.8	6,374	渋谷工業	5.3	11,766	明電舎	53	19,345	共和電機	15.5	6,200
宮地エンジニアリングG	32	6,528	アイチ コーポレーション	9.9	8,405	山洋電気	16	11,776	堀場製作所	11.4	58,026
トーカロ	4.4	10,898	小森コーポレーション	14.6	21,345	デンヨー	5.7	8,287	アドバンテス	39.5	61,264
S U M C O	63.9	80,066	鶴見製作所	5.2	8,949	東芝テック	36	20,340	エスベック	5.9	7,392
川田テクノロジーズ	1.4	9,380	住友精密	18	6,264	芝浦メカトロニクス	18	4,752	キーンズ	13.2	1,032,636
東洋製罐グループHD	42.6	91,760	荏原製作所	25.1	74,647	マフチマーター	16.5	105,105	日置電機	3.5	7,234
ホッカンホールディングス	21	8,547	西島製作所	7.7	8,339	日本電産	75.6	774,144	シスメックス	45.3	312,117
横河ブリッジH L D G S	11.1	14,552	北越工業	10	7,760	東光高岳	3.4	6,776	日本マイクロナイクス	11.3	11,379
駒井ハルテック	2.8	5,871	ダイキン工業	79.5	851,842	ダブル・スコープ	5.8	11,008	メガチップス	5.8	15,712
三和ホールディングス	60.5	68,365	オルガノ	16	7,552	ダイヘン	32	22,912	O B A R A GROUP	3.5	18,480
文化シヤッター	17.6	15,294	トヨーカナetz	34	12,036	田淵電機	12.2	4,465	コーセル	8.7	10,109
三協立山	8.1	12,652	栗田工業	33.7	80,138	J V C ケンウッド	43.8	13,928	イリソ電子工業	1.9	12,787
アルインコ	6.5	6,519	椿本チエイン	34	30,600	日新電機	11.9	15,505	オプテックス	4.5	12,888
L I X I L グループ	85.1	216,494	アナスト岩田	11.5	13,064	大崎電機	12	13,812	千代田インテグレ	3.4	7,799
ノーリツ	11.8	24,001	ダイフク	29.4	64,974	オムロン	61.9	261,218	レーザータック	7.1	14,846
長府製作所	6.8	18,094	加藤製作所	3.8	11,156	日東工業	8.2	13,193	スタンレー電気	41.5	130,932
リンナイ	10.4	101,192	油研工業	38	7,676	I D E C	8.2	8,364	岩崎電機	38	6,612
岡部	13.4	13,534	タダノ	30.3	36,905	ジー・エス・ユアサ コーポ	111	51,171	ウシオ電機	35.4	48,816
ジーテクト	6.4	13,548	C K D	17.5	24,080	サクサホールディングス	20	4,380	日本セラミック	5.1	10,745
東プレ	11.7	31,636	キトー	8.5	9,503	メルコホールディングス	3.4	9,945	遠藤照明	6.4	5,459
高周波熱練	12	10,896	平和	17.7	43,559	富士通	800	238,400	日本デジタル研究所	6.1	14,713
東京製鋼	4.6	9,696	理想科学工業	6	11,874	電気興業	562	379,237	古河電池	6	4,854
パイオラックス	3.1	21,297	S A N K Y O	15.8	57,117	沖電気	25	38,550	山一電機	6.8	7,337
日本発条	56	60,032	日本金銭機械	5.9	9,180	サンケン電気	18	10,458	図研	5.3	5,861
三益半導体	5.3	7,266	マースエンジニアリング	3.5	7,192	アイホン	35	16,975	日本電子	22	9,922
機械 (5.1%)			福島工業	3.8	12,540	ルネサスエレクトロニクス	4.1	7,576	カシオ	48.7	72,806
日本製鋼所	20.4	41,473	ダイゴ電機	3.3	5,629	セイコーエプソン	32.1	27,477	ファナック	59.1	1,140,925
三浦工業	25.1	43,322	竹内製作所	10.8	26,330	ワコム	86.6	198,573	日本シイエムケイ	13.8	8,280
タクマ	20	19,200	アマノ	17.9	34,350	アルバック	46.5	14,275	エンプラス	2.7	8,896
ツガミ	18	11,340	J U K I	10.2	9,924	アクセル	10.7	36,754	ローム	28.2	176,250
オークマ	39	39,039	サンデンホールディングス	37	13,505	E I Z O	5.2	4,420	浜松ホトニクス	45.4	137,789
東芝機械	37	15,910	蛇の目マシン	7.3	5,810	ジャパンディスプレイ	5.7	19,209	三井ハイテック	8.8	5,984
アマダホールディングス	81.3	103,494	マックス	9	12,114	日本信号	108.7	28,805	新光電気工業	20.6	14,481
アイダエンジニア	17.6	18,462					16.1	14,779	京セラ	95.6	519,681

銘柄	2016年11月30日現在 株数 評価額	銘柄	2016年11月30日現在 株数 評価額	銘柄	2016年11月30日現在 株数 評価額	銘柄	2016年11月30日現在 株数 評価額
太陽誘電	千株 千円 27.5 34,237	日機装	千株 千円 20 20,760	北海道電力	千株 千円 54.8 45,484	キューソー流通システム	千株 千円 2.3 5,317
村田製作所	61.2 944,010	島津製作所	75 130,725	沖縄電力	8.5 19,754	郵船ロジスティクス	6 6,684
ユシン	10 7,340	JMS	24 6,864	電源開発	46.2 115,915	近鉄エクスプレス	10.6 17,203
双葉電子工業	9.7 17,285	ブイ・テクノロジ	1.2 14,388	イーレックス	2.5 7,330	東海運	8.7 4,158
北陸電気工業	45 5,760	東京計器	32 6,880	東京瓦斯	625 311,687	内外トラストライン	4.9 5,541
ニチコン	18.1 17,973	東京精密	11.1 35,742	大阪瓦斯	564 243,986	情報・通信業 (7.5%)	
日本ケミコン	56 12,992	マニ	7.8 18,954	東邦瓦斯	147 133,182	NECネットエスアイ	6.1 12,620
KOA	8.8 9,319	ニコン	100.5 168,840	北海道瓦斯	21 5,691	システナ	5.1 8,262
市光工業	16 6,032	トプコン	29.5 50,120	広島ガス	15.5 5,332	デジタルアーツ	2.9 7,084
小糸製作所	35 208,600	オリパス	92.8 373,056	西部瓦斯	67 16,482	新日鉄住金 S O L	9.7 21,078
ミツバ	10.9 17,745	理研計器	5.7 8,447	静岡ガス	18.2 14,341	ソフトクリエイトHD	5.8 7,934
SCREENホールディングス	12 81,840	タムロン	5.2 9,978	メタウォーター	3.4 9,737	T I S	19.2 46,176
キャノン電子	5 8,540	HOYA	122.2 549,777	陸運業 (4.3%)		電算システム	3.1 5,542
キャノン	312.8 1,020,040	ノーリツ鋼機	6.9 5,416	SBSホールディングス	6.6 5,933	グリー	36.5 22,192
リコー	174.1 160,346	エー・アンド・デイ	12.7 5,829	東武鉄道	308 168,784	コーエーテックモHD	13.8 26,427
東京エレクトロン	38.9 407,477	シチズン時計	64 44,736	相鉄ホールディングス	93 52,173	三菱総合研究所	2.5 8,100
輸送用機器 (9.8%)		リズム時計	39 7,215	東京急行	316 269,864	ファインデックス	4.8 4,329
トヨタ紡織	20.5 53,320	大研機器	6.9 5,747	京浜急行	159 195,411	K L a b	12.2 7,844
ユニプレス	11.2 24,539	メニコン	4.1 11,894	小田急電鉄	93.4 208,935	ポルトラヴィン・ピットクル	5.7 5,221
豊田自動織機	53 284,080	松風	4.1 5,535	京王電鉄	162 147,744	ネクソン	63.5 101,536
モリタホールディングス	11 18,018	セイコーHD	40 16,120	京成電鉄	43.5 118,059	アイスタイル	9.4 7,012
三梭工業	10.2 7,456	ニプロ	39.3 49,439	富士急行	17 18,054	エイチーム	3.7 8,931
デンソー	143.8 716,124	その他製品 (1.9%)		新京成電鉄	13 5,317	テクノスジャパン	2.5 6,742
東海理化電機	15.3 34,317	パラマウントベッドHD	5.6 23,464	東日本旅客鉄道	112.8 1,101,604	コロプラ	16.4 15,858
二井造船	203 33,292	ニホンフラッシュ	3.8 4,529	西日本旅客鉄道	56 389,592	ブロードリーフ	7.9 10,767
川崎重工業	453 163,533	前田工織	7 8,596	東海旅客鉄道	48.5 905,980	ハーツユナイテッドグループ	3.5 5,684
名村造船所	18.1 12,923	大産産業	13 6,383	西武ホールディングス	80.4 164,900	ティエガイア	5.8 9,900
日本車輛	26 7,384	アートネイチャー	8.5 5,278	鴻池運輸	8.4 13,045	豆蔵ホールディングス	5.6 5,628
日産自動車	697.2 736,591	ダンロップスポーツ	4.5 4,725	西日本鉄道	69 35,052	テクマトリックス	2.5 4,710
いすゞ自動車	169.1 228,115	バンダイナムコHLDGS	64.3 209,939	ハマキョウレックス	4.3 8,823	ガンホー・オンライン・エンター	122.5 31,115
トヨタ自動車	724.8 4,819,195	共立印刷	27.2 8,513	サカイ引越センター	2.4 5,776	GMOペイメントゲートウェイ	4.8 22,608
日野自動車	83 96,363	S H O E I	3.2 6,492	近鉄グループHLDGS	585 258,570	インターネットイニシアティブ	8.8 14,432
三菱自動車工業	214.6 113,523	フランスペッドHLDGS	7.8 7,105	阪急阪神HLDGS	73.3 264,979	さくらインターネット	4.8 4,579
エフテック	4.4 5,658	パイロットコーポレーション	10.3 48,770	南海電鉄	122 63,806	S R Aホールディングス	3.5 8,151
武蔵精密工業	6.7 19,001	秋原工業	2.5 6,070	京阪ホールディングス	130 94,640	朝日ネット	18.5 8,510
日産車体	25.6 28,902	トッパン・フォームズ	9.4 10,246	神戸電鉄	18 6,624	コムチュア	1.5 4,965
新明和工業	23 22,126	フジールインターナショナル	6.6 30,558	名古屋鉄道	212 118,932	g u m i	6.7 4,850
極東開発工業	11.9 17,612	タカラトミー	23 26,749	山陽電鉄	23 13,524	L I N E	9.8 43,218
日信工業	12.3 20,664	大建工業	4.5 9,027	日本通運	225 132,975	野村総合研究所	39.1 151,708
トピー工業	4.9 14,131	凸版印刷	161 166,957	ヤマトホールディングス	104.4 239,232	インテージホールディングス	3.7 6,944
ティアド	28 8,660	大日本印刷	167 180,694	山九	76 50,540	フジ・メディア・HD	59.5 91,273
曙ブレーキ	29.8 9,148	共同印刷	21 8,022	丸全昭和運輸	22 9,724	オービック	19.9 100,097
タチエス	10.3 17,510	日本写真印刷	9.9 23,987	センコー	26.1 21,088	ジャストシステム	10.1 10,948
NOK	28.1 63,927	光村印刷	25 5,325	トナミホールディングス	16 5,536	TD(ソフトラウェア)アジア	4.7 5,278
フタバ産業	19.2 13,286	宝印刷	4.8 6,744	ニコソホールディングス	19.4 46,404	ヤフー	418.7 174,179
K Y B	65 33,800	アクスス	57.9 139,423	福山通運	34 21,250	トレンドマイクロ	30.5 125,355
大同金属工業	8 8,720	ツツミ	2.7 4,897	セイノーホールディングス	40.7 51,729	日本オラル	9.4 53,580
プレス工業	31.5 15,718	ヤマハ	39.2 136,612	神奈川中央交通	8 5,840	フューチャー	10.2 7,415
カルソニックカンセイ	40 70,160	河合楽器	3.2 6,860	日立物流	12.1 28,301	CAC HOLDINGS	6.7 6,036
太平洋工業	12.2 17,446	クリナップ	8.1 7,662	丸和運輸機関	1.8 5,328	ソフトバンク・テクノ	1.6 4,376
ケーヒン	12.9 24,123	ピジコン	35.4 102,058	九州旅客鉄道	43.1 127,662	オービックビジネスC	3 14,460
河西工業	8.3 10,458	キングジム	7.8 6,614	海運業 (0.2%)		伊藤忠テクノソリューションズ	13.2 40,656
アイシン精機	53.3 260,637	リンテック	13.1 31,767	日本郵船	487 103,244	アイティフォー	11.1 7,059
マツダ	184.2 337,822	イトーキ	12.9 9,610	商船三井	303 89,082	大家商会	15.5 86,335
今山電機製作所	7.3 6,803	任天堂	35.9 997,122	川崎汽船	218 54,718	サイボウズ	12.6 5,632
本田技研	524.5 1,747,634	三菱鉛筆	4.9 29,155	N S ユナイテッド海運	32 6,624	ソフトブレーン	10.1 3,959
スズキ	115.8 426,144	タカラスタンダード	12.1 22,893	飯野海運	30.9 12,978	電通国際情報 S	3.9 7,226
富士重工	181 840,745	コクオ	30.3 40,450	空運業 (0.6%)		デジタルガレージ	9.2 18,455
ヤマハ発動機	82.4 216,794	ナカバヤシ	2.1 5,250	日本航空	104.6 354,071	ウェザーニューズ	2.2 7,392
ショウワ	16.1 11,012	グローブライド	3.5 6,293	ANAホールディングス	1,077 341,732	C I J	16.4 8,511
T B K	17.1 8,139	岡村製作所	19.8 19,265	倉庫・運輸関連業 (0.2%)		WOWOW	3.1 9,281
エクセディ	7.5 23,587	美津濃	31 17,236	トランコム	1.8 10,026	ネットワンシステムズ	25.3 19,531
豊田合成	18.4 45,448	電気・ガス業 (1.8%)		日新	26 8,814	アルゴグラフィックス	3.7 8,047
愛三工業	9.9 9,197	中部電力HD	494.4 210,120	三菱倉庫	38 58,786	マーベラス	10.3 7,982
コロス	5.7 9,165	東電電力	191.9 308,095	三井倉庫HOLD	36 12,024	エイベックス・グループHD	10.6 16,758
エフ・シー・シー	9.6 18,988	関西電力	238.1 268,576	住友倉庫	41 24,067	日本ユニシス	16.3 23,015
シモノ	23.5 441,565	中国電力	79.6 103,639	渋沢倉庫	28 9,464	兼松エレクトロニクス	3.8 9,382
ティ・エス テック	13.4 40,401	北陸電力	56 69,328	東陽倉庫	28.1 7,952	東京放送HD	38.1 68,160
ジャムコ	3.7 8,362	東北電力	145.1 193,418	日本トランスシティ	19 7,581	日本テレビHLD S	52.6 102,359
精密機器 (1.5%)		四国電力	52.4 57,168	東洋埠頭	43 8,084	テレビ朝日HD	15.9 34,153
デルモ	89.2 359,030	九州電力	129.1 145,237	上組	68 71,400	スカパーJSATHD	37.7 20,584

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄				銘柄				銘柄				銘柄				銘柄			
株数 千円 評価額				株数 千円 評価額				株数 千円 評価額				株数 千円 評価額				株数 千円 評価額			
テレビ東京HD 5 11,125				I DOM 16.6 9,428				エディオン 21.3 23,408				サトレストランシシステムズ 9.4 7,679				サトレストランシシステムズ 9.4 7,679			
ワイヤレスゲート 2.7 4,563				進和 4.5 7,528				サーコーポレーション 8.8 5,544				千趣会 11.4 8,561				千趣会 11.4 8,561			
コネクショ 5.3 7,420				シークス 4.1 15,703				ワッツ 6.9 7,217				ケーヨー 12.1 6,558				ケーヨー 12.1 6,558			
日本通信 52.4 8,122				伊藤忠 421.5 658,383				ハローズ 2.1 4,964				上新電機 14 13,328				上新電機 14 13,328			
日本電信電話 461.5 2,134,437				丸紅 564.9 353,796				あみやき亭 1.6 6,344				日本瓦斯 10.6 34,874				日本瓦斯 10.6 34,874			
KDDI 569.2 1,707,030				高島 37 7,030				ひらまつ 10.7 6,634				ロイヤルホールディングス 9.3 17,995				ロイヤルホールディングス 9.3 17,995			
光通信 6.9 70,380				長瀬産業 32 45,888				ゲンキー 1.2 6,756				いなげや 6.6 9,405				いなげや 6.6 9,405			
NTTドコモ 429.8 1,127,795				蝶理 4.3 7,348				大黒天物産 1.5 7,365				島忠 14.6 43,084				島忠 14.6 43,084			
エムティーアイ 10 7,490				豊田通商 63.6 181,832				ハニーズ 6 7,128				チヨダ 6.8 18,033				チヨダ 6.8 18,033			
GMOインターネット 21.6 33,890				兼松 121 22,869				アルペン 4.8 10,612				ライフコーポレーション 4.5 14,602				ライフコーポレーション 4.5 14,602			
カドカワ 16.9 26,347				三井物産 521.2 803,429				クオール 6.9 10,101				リンガーハット 5.8 12,127				リンガーハット 5.8 12,127			
学研ホールディングス 24 7,920				日本紙パルプ 28 9,744				ジェイアイエヌ 4 19,180				AOKIホールディングス 11.1 14,862				AOKIホールディングス 11.1 14,862			
ゼンリン 8 13,624				日立ハイテクノロジーズ 19.9 89,749				ビックカメラ 32.7 33,157				オークワ 8 9,352				オークワ 8 9,352			
松竹 37 45,732				カメイ 7.8 8,143				DCMホールディングス 32.8 33,882				コメリ 8.9 24,101				コメリ 8.9 24,101			
東宝 37.5 123,187				OUGホールディングス 28 7,252				MonotaRO 20.5 50,081				青山商事 11.8 45,843				青山商事 11.8 45,843			
東映 22 20,262				スターゼン 2.4 11,376				アークランドサービスHD 2.1 6,096				しまむら 6.7 91,254				しまむら 6.7 91,254			
NTTデータ 35.6 202,564				山善 22.2 19,913				J. フロント リテイリング 72.7 117,192				高島屋 95 90,155				高島屋 95 90,155			
DTS 6.3 15,951				住友商事 361.5 493,447				ドール・日レスHD 9.9 21,057				松屋 13.4 13,614				松屋 13.4 13,614			
スクウェア・エニックス・HD 22.2 64,002				内田洋行 19 8,702				マツモトキヨシHLDGS 10.8 58,968				エイ・ツ・オーリテイリング 29 49,619				エイ・ツ・オーリテイリング 29 49,619			
シーエーシー 3.9 7,386				二菱商事 432.4 1,068,676				プロコンポリス 3.3 10,048				近鉄百貨店 23 8,119				近鉄百貨店 23 8,119			
カブコン 13.6 33,972				第一実業 16 10,736				スタートトゥデイ 52.9 92,945				丸井グループ 60.7 95,663				丸井グループ 60.7 95,663			
ジャストテック 5.9 6,065				キャンマーケティングJPN 16.2 29,192				物語コーポレーション 1.8 7,938				アグリアル リテイリング 4.6 17,848				アグリアル リテイリング 4.6 17,848			
SCSK 15.8 62,805				西華産業 23 7,544				コカラフアイン 6.1 25,559				イオン 236.5 372,724				イオン 236.5 372,724			
アイネス 8.6 10,182				菱洋エレクトロ 6.2 8,531				三越伊勢丹HD 114.3 144,132				イズミ 11.5 57,615				イズミ 11.5 57,615			
TKC 5.6 17,304				ユアサ商事 5.4 15,190				ウエルシアHD 5.8 41,354				平和堂 11.6 26,250				平和堂 11.6 26,250			
富士ソフト 8.7 23,081				神鋼商事 3.3 7,263				クリエイトSDH 8.7 21,114				フジ 6.5 14,456				フジ 6.5 14,456			
NSD 12.7 22,288				阪和興業 57 42,351				丸善CHI HD 13.1 4,860				ヤオコー 6.6 28,710				ヤオコー 6.6 28,710			
コナミホールディングス 26 100,620				カナデン 7.6 7,706				チムニー 2 5,762				ゼビオホールディングス 7.6 13,376				ゼビオホールディングス 7.6 13,376			
福井コンピュータHLDGS 2 5,138				菱電商事 11 8,162				ジョイフル本田 9.2 29,578				ケースホールディングス 26.1 55,123				ケースホールディングス 26.1 55,123			
JBCCHホールディングス 15 10,335				岩谷産業 62 38,378				鳥貴族 1.6 3,995				アインホールディングス 7 55,930				アインホールディングス 7 55,930			
ミロク情報サービス 4.7 8,934				すてきなナイスグループ 45 6,840				すかいらーく 24.6 39,360				元気寿司 2.6 5,374				元気寿司 2.6 5,374			
ソノバンググループ 258.5 1,735,052				三菱石油 16.2 12,749				綿半ホールディングス 3.3 5,207				ヤマダ電機 191.3 116,884				ヤマダ電機 191.3 116,884			
卸売業 (4.4%)				稲畑産業 13.6 16,442				ユナイテッド・スーパーマ 18.8 17,634				アークランドサカモト 10.1 13,412				アークランドサカモト 10.1 13,412			
エレマテック 2.6 4,802				ウキタ 12.7 11,925				ブックオフコーポレーション 8.8 7,040				クニトリホールディングス 25 298,500				クニトリホールディングス 25 298,500			
あらた 2.9 7,000				東邦ホールディングス 18.2 40,331				あさひ 4.9 6,169				吉野家ホールディングス 19.3 30,050				吉野家ホールディングス 19.3 30,050			
フィールズ 4.7 6,345				サンゲツ 19.6 39,141				日本調剤 2.1 9,313				松屋フーズ 2.8 9,744				松屋フーズ 2.8 9,744			
双日 335.7 97,353				ミツウロコグループ 9.6 6,758				コスモス薬品 2.9 60,697				サガミチェーン 8.5 10,778				サガミチェーン 8.5 10,778			
アルフレッサホールディングス 67.8 123,599				シナネホールディングス 3 5,973				一六堂 22.4 8,310				関西スーパーマーケット 5.7 8,493				関西スーパーマーケット 5.7 8,493			
横浜冷凍 14.7 15,288				伊藤忠エネクス 12.6 10,886				セブン&アイ・HLDGS 240.9 1,068,391				王将フードサービス 4.2 17,430				王将フードサービス 4.2 17,430			
山下医科器械 3.3 5,626				サンリオ 17.3 34,842				薬王堂 3.3 7,306				アピス 6.3 14,061				アピス 6.3 14,061			
アルコニック 5.2 8,288				リョーサン 8.4 28,896				クリエイト・レストランツ・ホ 15.6 15,709				ミニストップ 4.1 7,814				ミニストップ 4.1 7,814			
神戸物産 3.2 9,680				新光商事 7.8 9,453				ソルハホールディングス 13.3 155,344				アークス 10.8 27,993				アークス 10.8 27,993			
あいホールディングス 10.5 26,386				トーホー 3.5 8,725				サンマルクホールディングス 3.7 13,098				パローホールディングス 12.4 33,876				パローホールディングス 12.4 33,876			
ディービーエックス 3.7 5,106				三信電気 7.5 7,042				ドリトルホールディングス 7.2 17,820				ベルク 2.7 11,110				ベルク 2.7 11,110			
ダイワボウHD 49 14,749				東陽デクニカ 8.3 7,926				ダユー・リックHLDGS 9.5 6,374				大庄 4.4 6,793				大庄 4.4 6,793			
マクニ・エスエスHLDGS 10.5 14,280				モスフード サービス 7.4 25,197				グスリのアオキHLDGS 5.3 25,784				ファーストリテイリング 9.6 379,872				ファーストリテイリング 9.6 379,872			
バイタルKSKHD 10.6 10,207				加賀電子 5.7 10,790				総合メディカル 3.1 10,772				サンドラッグ 11 87,560				サンドラッグ 11 87,560			
UKCホールディングス 4.2 8,794				PALTAC 9.3 23,687				ノジマ 6.9 9,225				サックスホールディング 6.3 7,648				サックスホールディング 6.3 7,648			
TOKAIホールディングス 25.2 19,000				ヤマタネ 6.1 9,058				カッパ・クリエイト 8.8 10,876				ペルナ 15.5 9,920				ペルナ 15.5 9,920			
三洋貿易 5 7,675				丸紅建材リース 28 5,712				ライオン 5.1 5,161				銀行業 (8.3%)				銀行業 (8.3%)			
ウイン・パートナーズ 3 5,553				日鉄住金物産 47 20,774				良品計画 7.6 170,468				じもとホールディングス 52.5 10,027				じもとホールディングス 52.5 10,027			
シッパースケアHD 10.9 32,558				トラスコ中山 6.7 34,706				アドヴァン 6.8 7,568				めびきフィナンシャルG 276.4 114,982				めびきフィナンシャルG 276.4 114,982			
コダホールディングス 7.7 13,305				オートバックスセブン 20.6 34,196				アルビス 2.4 7,058				東京TYフィナンシャルG 8.4 31,710				東京TYフィナンシャルG 8.4 31,710			
小野建 5.8 7,093				加藤産業 8.8 22,184				コナカ 12.5 6,800				九州フィナンシャルG 93.9 70,706				九州フィナンシャルG 93.9 70,706			
佐島電機 8.9 6,336				イネテック 10.7 5,628				コーナン商事 8.1 17,520				ゆうちょ銀行 163.3 220,291				ゆうちょ銀行 163.3 220,291			
伯東 5.5 5,522				エネローハット 5.6 13,087				ワタミ 7.2 7,876				富山第一銀行 15.9 8,315				富山第一銀行 15.9 8,315			
コンドレーツ 8.3 6,714				日伝 2.5 7,850				ドンキホーテホールディン 37.3 163,187				コンコリア・フィナン 374.9 197,009				コンコリア・フィナン 374.9 197,009			
ナガイレーベン 8.6 20,399				因幡電機産業 7.5 29,062				西松屋チェーン 10.3 15,244				西日本フィナンシャルHD 38.2 41,065				西日本フィナンシャルHD 38.2 41,065			
三菱食品 6.2 20,429				ミスミグループ本社 64.7 132,376				ゼンショーホールディングス 29.8 58,288				新生銀行 545 99,735				新生銀行 545 99,735			
松田産業 4.8 7,012				スズケン 25.9 88,578				幸楽苑ホールディングス 5.7 9,017				あおぞら銀行 360 141,480				あおぞら銀行 360 141,480			
第一興商 9.3 41,524				ジェコス 5 4,970				サイゼリヤ 9.4 25,991				三菱UFJフィナンシャルG 4,360.3 2,920,528				三菱UFJフィナンシャルG 4,360.3 2,920,528			
メディアパルHD 57.4 93,963				小売業 (4.8%)				VTホールディングス 20.4 11,383				リソネホールディングス 672.2 369,777				リソネホールディングス 672.2 369,777			
萩原電気 3.3 6,887				ロソン 20 158,400				ポプラ 11.4 5,757				三井住友トラストHD 120.2 498,830				三井住友トラストHD 120.2 498,830			
アズワン 4.5 21,937				サンエー 4.4 24,244				ユナイテッドアローズ 7.8 22,471				三井住友フィナンシャルG 460.5 1,936,863				三井住友フィナンシャルG 460.5 1,936,863			
シモジマ 6.2 6,776				カワチ薬品 4.7 12,657				ハイデジ日高 5.4 14,585				第四銀行 69 33,120				第四銀行 69 33,120			
ドウシシャ 7.1 14,654				エーピーシー・マート 10.5 70,455				京都きもの友禅 10.7 10,143				北越銀行 6.3 16,058				北越銀行 6.3 16,058			
小津産業 2.6 5,449				ハードオフコーポレーショ 4.4 5,073				クロワッド 18.8 35,644				千葉銀行 220 149,160				千葉銀行 220 149,160			
黒田電気 7.8 17,924				アスフル 7.1 29,216				香番屋 5.2 19,500				群馬銀行 124.7 72,450				群馬銀行 124.7 72,450			
丸文 8.2 5,608				ガスホールディングス 9.4 11,637				スギホールディングス 12.6 67,284				武蔵野銀行 8.7 26,665				武蔵野銀行 8.7 26,665			
ハピネット 5.8 7,650				アダストリア 8.9 28,747				スクロール 12.1 4,271				千葉興業銀行 19.3 10,093				千葉興業銀行 19.3 10,093			
日本ライフライン 5 12,925				くらこコーポレーション 3.8 18,620				ヨンドーホールディングス 4.5 11,821				筑波銀行 30.2 10,147				筑波銀行 30.2 10,147			
エクセル 3.4 4,885				キャンドゥ 4.3 7,649				ユニ・ファミリーマートHD 25.3 180,895				七十七銀行 86 46,354				七十七銀行 86 46,354			
マルカキカイ 3.5 4,949				パルグループHLDGS 3.2 9,497				木曽路 7.1 16,209				青森銀行 45 19,920				青森銀行 45 19,920			

銘柄 柄				銘柄 柄				銘柄 柄				銘柄 柄			
2016年11月30日現在				2016年11月30日現在				2016年11月30日現在				2016年11月30日現在			
株数 評価額				株数 評価額				株数 評価額				株数 評価額			
千株 千円				千株 千円				千株 千円				千株 千円			
秋田銀行 37 13,653				いちよし証券 13.6 11,152				イオンモール 36.6 60,390				ベクトル 5.6 6,753			
山形銀行 33 15,510				松井証券 29.9 26,312				ファースト住建 3.5 5,288				アサネット 3.6 6,116			
岩手銀行 3.6 16,596				マネックスG 60.9 16,443				トーセイ 9.3 7,728				N・フィールド 3.8 5,038			
東邦銀行 50 20,600				カブドットコム証券 39.8 14,566				エヌ・ティ・ティ都市開発 34.8 34,312				リクルートホールディングス 133.1 580,981			
東北銀行 64 9,472				極東証券 7.6 12,631				サンフロンティア不動産 6.9 6,782				日本郵政 159.4 225,869			
みちのく銀行 33 7,194				岩井コスモホールディング 8 7,776				エフ・ジェー・ネクスト 8.2 5,805				ベルシス24HLDGS 9.7 9,050			
ふくおかフィナンシャルG 232 114,840				藍澤證券 12.9 8,127				グランディハウス 13.2 5,016				リロググループ 2.3 36,110			
静岡銀行 155 143,375				マコーパートナーズGP 8.6 4,128				日本空港ビルデング 18.4 78,292				東祥 1.5 7,545			
十六銀行 74 27,158				保険業 (2.6%)				サービス業 (3.7%)				エイチ・アイ・エス 10 31,500			
スルガ銀行 58.8 151,527				かんぽ生命保険 21.7 50,105				日本工営 22 10,956				共立メンテナンス 5 34,650			
八十二銀行 108.2 66,326				SOMPOホールディングス 119.8 446,614				ネクスト 15.9 12,735				イネッサホールディングス 8.7 9,456			
山梨中央銀行 35 17,710				アニコムホールディングス 4.1 11,070				ジェイエイ・リクルートメント 4.3 5,654				建設技術研究所 6.2 6,293			
大垣共立銀行 76 31,236				MS & AD 171.5 608,653				日本M&Aセンター 17.7 55,224				東京テアトル 8.4 15,456			
福井銀行 51 14,229				SONY F.H 54.7 90,255				アコーディア・ゴルフ 18.9 22,661				タナベ経営 3.7 4,802			
北国銀行 58 23,026				第一生命HLDGS 346.9 636,041				タケエイ 6.8 6,099				ナガワ 1.2 5,148			
清水銀行 2.5 8,412				東京海上HD 232.8 1,140,487				トラスト・テック 3.3 4,966				よみうりランド 15 7,035			
滋賀銀行 4.9 29,204				T & Dホールディングス 209.1 298,803				パソナグループ 6.1 4,709				東京都競馬 43 11,997			
京都銀行 5.4 22,437				アドバンスクリエイト 3 5,361				CD S 8 8,088				常磐興産 5.2 7,987			
南都銀行 49 21,364				その他金融業 (1.3%)				リングアンドモチベーション 17.3 6,798				カナモト 8.5 22,185			
百五銀行 102 80,886				全国保証 16.4 63,550				GCA 6.4 5,881				東京ドーム 24.4 28,718			
紀陽銀行 22 38,280				クレディセゾン 43.2 88,603				エス・エム・エス 8.5 24,293				西尾レントオール 5 15,300			
三重銀行 3.8 8,534				芙蓉総合リース 6.5 35,100				デンパホールディングス 47.4 83,518				トランス・コスモス 7.3 20,301			
はくほくフィナンシャルG 37.1 68,783				興銀リース 10.6 25,577				リニカル 4.1 5,366				乃村工業社 13.2 22,096			
広島銀行 168 84,672				東京センチュリー 11.5 42,492				クックパッド 14.2 14,569				藤田観光 22 7,238			
山陰合同銀行 34.3 29,943				日本証券金融 25.9 14,115				スタジアムアリス 2.9 6,675				KNT-CTホールディングス 42 6,174			
中国銀行 39.8 61,530				アイフル 97.4 34,382				シミックホールディングス 4 6,004				日本管財 5.5 8,970			
鳥取銀行 4.2 7,450				リコリース 4.5 15,750				総合警備保障 22.2 103,341				トーカイ 2.9 10,585			
伊予銀行 59.2 43,452				イオンフィナンシャルサービス 36.7 69,876				カカコム 44.1 79,159				セコム 63.1 524,928			
百十四銀行 61 23,241				アコム 118.2 64,655				ルネサンス 4.7 6,721				セントラル警備保障 3.3 7,207			
四国銀行 44 12,936				ジャックス 33 17,523				ディップ 8.1 19,464				丹青社 11.6 8,746			
阿波銀行 47 31,678				オリコ 127.5 25,755				オプトホールディング 7.7 5,490				メイテック 7.3 31,353			
大分銀行 34 13,872				日立キャピタル 13.7 38,387				新日本科学 7.7 4,512				アサツー ディ・ケイ 9.8 29,645			
宮崎銀行 40 14,480				オリックス 407.9 726,673				ツクイ 16 11,472				応用地質 6.3 8,442			
佐賀銀行 36 9,972				三菱UFJリース 145.6 76,731				エムスリー 53.3 157,394				船井総研ホールディン 8.3 14,757			
十八銀行 37 12,617				日本取引所グループ 179.3 303,734				アウトソーシング 3.3 11,962				学究社 4.7 6,401			
沖縄銀行 5.6 23,940				イー・ギランティ 2.4 5,988				ウェルネット 5.4 7,025				ベネッセホールディングス 20.4 61,914			
琉球銀行 12.4 18,302				NECキャピタルソリューション 2.9 4,959				ディー・エヌ・エー 27.5 95,837				イオンデパート 6.7 21,038			
セブ銀行 214.7 69,992				不動産業 (2.7%)				博報堂DHYHLDGS 84.5 112,216				ニチヤ館 11.2 9,811			
みずほフィナンシャルG 7,801.5 1,580,583				いちご 55 24,035				ぐるなび 9 21,834				ダイセキ 10.6 23,118			
高知銀行 68 8,500				日本駐車場開発 74.1 12,152				エスアールジータカミヤ 8.5 5,576				株数・金額 88,072.5 124,953,943			
山口フィナンシャルG 52 61,880				ヒューリック 120.1 128,987				ジャパネットホリクス 20.3 5,237				銘柄数<比率> 1,501 銘柄<99.0%>			
長野銀行 3.2 6,428				野村不動産HLDGS 37.6 69,635				ファンコミュニケーションズ 15.8 11,865				(注1) 銘柄柄欄の()内は国内株式の評価			
名古屋銀行 4.7 18,024				三重交通グループHD 12 4,716				ティア 9.9 6,118				総額に対する各業種の比率。			
北洋銀行 90 40,320				サムディ 5.6 5,964				インフォーマット 13.5 15,714				(注2) 合計欄の<>内は、純資産総額			
愛知銀行 2 12,900				日本商業開発 3.6 6,930				J Pホールディングス 21.8 5,755				に対する評価額の比率。			
第二銀行 4.4 8,030				プラスコーポレーション 9.5 13,556				E P Sホールディングス 7.9 10,601				(注3) 評価額の単位未満は切捨て。			
中京銀行 2.8 6,599				ユニゾホールディングス 4.9 15,998				エスステージ・インター 9.8 7,918							
大光銀行 31 8,122				日本管理センター 4.7 6,481				アミューズ 3.8 6,216							
愛媛銀行 5.2 7,098				フージャースHD 11.1 6,737				ドリームインキュベータ 2.1 4,428							
トマト銀行 5 8,110				オープンハウス 8.5 24,038				クイック 4.4 4,153							
みなと銀行 5.2 10,129				東急不動産HD 137.1 89,800				ケネディクス 82 34,604							
京葉銀行 43 20,984				飯田GHD 47.8 106,020				電通 67.9 355,117							
関西アーバン銀行 7.5 9,690				パーク24 29.1 94,575				イオンファンタジー 1.9 5,994							
栃木銀行 32.3 16,053				パラカ 2.7 5,478				シーティーエス 4.9 6,164							
北日本銀行 2.5 7,687				三井不動産 305 820,602				みらかホールディングス 15.5 79,360							
東和銀行 11.8 12,744				三菱地所 428 986,754				アルファテック 2.9 7,592							
福島銀行 91 8,463				平和不動産 11 17,974				オリエンタルランド 65.9 429,470							
大東銀行 43 7,267				東京建物 66.1 97,563				ダスキン 15.1 34,714							
トモニホールディングス 47 27,730				ダイビル 14.9 15,183				光明ネットワークジャパン 9 8,901							
フィデアホール 58.8 11,289				京阪神ビルディング 11.5 6,727				ファルコホールディングス 6.4 8,998							
池田泉州HD 57.2 28,256				住友不動産 138 435,942				ラウンドワン 19.7 15,700							
証券・商品先物取引業 (1.2%)				大京 104 25,168				リゾートトラスト 23.6 52,274							
FPG 21.2 19,355				テオシー 22.7 22,450				ビー・エム・エル 8.1 21,335							
SBIホールディングス 64.8 92,793				東京楽天地 13 6,578				りらいあコミュニケーション 10.3 11,340							
ジャフコ 9.6 37,920				レオパレス21 71.6 44,463				リソー教育 11.5 6,612							
大和証券G本社 535 367,759				スターツコーポレーション 6.1 12,724				ユー・エス・エス 73.6 134,761							
野村ホールディングス 1,176 722,064				フジ住宅 9.2 6,660				サイバーエージェント 32.3 89,826							
岡三証券グループ 46 30,222				空港施設 9.8 5,644				楽天 312.3 352,274							
丸三証券 18.3 17,019				住友不動産販売 4.9 13,661				オー・オー・ダブリュ 8 5,168							
東洋証券 36 8,496				ゴールドフレスト 5.4 11,712				セントラルスポーツ 3.1 8,363							
東海東京HD 63.3 37,410				日神不動産 12.6 6,526				フルキャストホールディングス 7.1 6,425							
光世証券 52 8,372				タカラレーベン 25.5 17,212				テクノロ・ホールディング 9.9 35,986							
水戸証券 31.9 9,346				サンヨーハウジング 名古屋 6.6 6,540				ジャパンマテリアル 2.4 8,916							

2016年11月30日現在

買建額 売建額

国内 TOPIX 百万円 1,179 百万円 -

(注) 単位未満は切捨て。

有価証券の貸付および借入状況

区分	2016年11月30日現在		
	貸付	借入	株
株式	2,649,900 (1,821,200)	株 入 (-)	

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
(注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券へ1,821,200株をお貸けしています。

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別		2016年11月30日現在	
		買建額	売建額
国内	TOPIX	百万円 1,179	百万円 -

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付および借入状況

区 分	2016年11月30日現在	
	貸 付	借 入
株式	株 2,649,900 (1,821,200)	株 — (—)

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
 (注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券へ1,821,200株を貸付けている。

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第28期（決算日 2016年9月20日）

（計算期間 2015年9月25日～2016年9月20日）

トピックス・インデックス・マザーファンドの第28期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

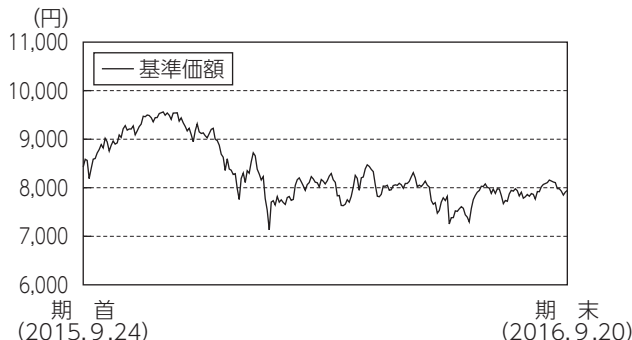
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額 円	T O P I X (ベンチマーク)		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰落率 %	騰落率 %		
(期首)2015年 9月24日	8,429	—	—	99.1	0.9
9月末	8,400	△ 0.3	△ 1.1	98.0	2.0
10月末	9,275	10.0	9.2	98.5	1.6
11月末	9,409	11.6	10.7	99.1	1.0
12月末	9,225	9.4	8.4	98.7	1.3
2016年 1月末	8,539	1.3	0.4	98.0	2.1
2月末	7,739	△ 8.2	△ 9.0	98.8	1.4
3月末	8,110	△ 3.8	△ 5.6	98.1	1.9
4月末	8,068	△ 4.3	△ 6.1	98.6	1.5
5月末	8,310	△ 1.4	△ 3.3	98.3	1.7
6月末	7,513	△ 10.9	△ 12.7	98.3	1.8
7月末	7,979	△ 5.3	△ 7.3	99.1	0.8
8月末	8,020	△ 4.9	△ 6.8	99.3	0.7
(期末)2016年 9月20日	7,944	△ 5.8	△ 7.7	99.7	0.2

(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：8,429円 期末：7,944円 騰落率：△5.8%

【基準価額の主な変動要因】

世界経済への先行き懸念や円高進行からTOPIXが下落したことを受けて、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、世界経済の先行き不透明感や円高の進行などで下落しましたが、2015年10月に入ると、世界経済に対する過度な不安感が後退したことやECB（欧州中央銀行）が追加金融緩和を示唆したこと、中国が追加金融緩和を実施したことなどで上昇しました。12月以降は、ECBの追加金融緩和策への失望や原油価格の下落、中国・人民元安と中国株安、円高などにより株価は下落しました。2016年1月末には、日銀がマイナス金利を導入し一時的に株価は上昇しましたが、その後は米国経済および中国経済への懸念や欧州金融機関への信用不安などで下落しました。2

月後半からは、米国の製造業関連指標の回復や中国およびECBの金融緩和などにより株価は反発しましたが、3月後半以降は、日米金融政策や米国為替政策への思惑から為替相場が不安定になり、株価も乱高下しました。6月には、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱支持が多数だったことを受けて株価は下落しましたが、7月以降は、国内の財政・金融政策への期待や円高傾向の一般などから上昇しました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（TOPIX）の騰落率は△7.7%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△5.8%となりました。

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

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2015年9月25日から2016年9月20日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 8,579.9 (△3,532.419)	千円 8,281,785 ()	千株 4,031.28	千円 4,354,127

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2015年9月25日から2016年9月20日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	百万円 14,012	百万円 14,792	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

(2015年9月25日から2016年9月20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
日本郵政		184.2	328,647	1,784	トヨタ自動車		88.38	652,407	7,381
ゆうちょ銀行		153.2	250,353	1,634	日本たばこ産業		24.3	99,651	4,100
ソフトバンクグループ		33.9	213,547	6,299	富士重工業		16.2	75,877	4,683
トヨタ自動車		30.9	189,326	6,127	パナソニック		54.5	74,892	1,374
三井住友フィナンシャルG		42	176,060	4,191	KDDI		21.7	66,764	3,076
リクルートホールディングス		36.6	139,821	3,820	ファーストリテイリング		2	63,595	31,797
武田薬品		22.1	123,151	5,572	野村ホールディングス		74.6	56,817	761
三菱UFJフィナンシャルG		198.7	106,140	534	日本電信電話		12.1	55,655	4,599
日本電信電話		18.6	90,231	4,851	スズキ		16.6	53,249	3,207
日立		131	81,949	625	花王		9	51,733	5,748

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首 株数	当期末 株数	期末 評価額 千円	銘柄	期首 株数	当期末 株数	期末 評価額 千円	銘柄	期首 株数	当期末 株数	期末 評価額 千円
水産・農林業 (0.1%)				コアテック	12	12	6,360	ハウス食品G本社	23.1	21.9	49,187
極洋	37	35	9,485	中電工	9.7	7.5	14,865	カゴメ	21	23.1	57,495
日本水産	86.2	77.9	34,509	関電工	29	26	23,842	アリアケジャパン	6.1	5.6	29,400
マルハニチロ	15.3	14	34,692	ぎんでん	40.7	35.1	39,768	ニチレイ	71	71	75,331
サカタのタネ	11	10.7	27,552	東京エネシス	6	8	7,624	東洋水産	32.6	31.5	136,552
ホクト	7.5	7	12,558	トーエネック	12	11	5,225	日清食品HD	26.5	27.2	165,376
鉱業 (0.3%)				住友電設	6.1	6	6,210	永谷園ホールディングス	8	8	10,080
日鉄鉱業	23	20	7,760	日本電設工業	10.6	9.9	17,641	一正蒲鉾	0.4	—	—
三井松島	66	57	6,840	協和エクスオ	26.7	25.3	36,583	フジコ	7	6.9	14,959
国際石油開発帝石	333.5	338.9	280,168	九電工	12	12.2	41,236	ロックフィールド	4.2	8.4	11,944
日本海洋掘削	2.2	2.5	5,552	三機工業	13.9	14.3	11,954	日本たばこ産業	375.6	361.7	1,434,502
石油資源開発	9.1	10.2	21,205	日揮	64	65	109,785	わらべや日洋HD	4.4	4.1	8,122
K&Oエナジーグループ	5.2	5.1	7,007	中外炬工業	28	34	6,766	ユーグレナ	21	22.5	32,625
建設業 (3.1%)				太平電業	10	10	9,590	ミヨシ油脂	48	95	11,875
ショーボンドHD	6	6.8	31,042	高砂熱学	17.7	18.6	27,583	繊維製品 (0.8%)			
ミライト・ホールディングス	20.7	20.4	17,748	明星工業	14	13.9	6,463	クニセ工業	9.2	8.9	10,306
安藤・間	44.4	44.7	27,267	大気社	9.5	7.4	18,352	グンゼ	50	49	15,337
東急建設	23.9	22	21,538	ダイダ	11	10	7,830	東洋紡	253	244	40,016
コムシスホールディングス	28.5	27.1	49,836	日比谷総合設備	9	8.6	14,052	ユニチカ	235	233	13,048
ミサワホーム	9.5	8.9	6,764	東芝プラントシステム	10.1	9.9	15,780	富士紡ホールディングス	36	37	10,508
髙松コンストラクションGP	5.3	4.8	11,092	東洋エンジニア	33	35	10,885	日清紡ホールディングス	40	—	—
東建コーポレーション	2.7	2.8	20,888	千代田化工建	46	47	37,506	倉敷紡績	72	58	10,556
大成建設	328	340	258,400	新興プランテック	14.4	13.5	9,517	シキボウ	69	121	13,068
大林組	190	196	193,256	食料品 (4.9%)				日本毛織	20	18.6	12,982
清水建設	193	199	177,110	日本製粉	39	43	32,379	ダイドーリミテッド	15.6	14.7	6,012
飛鳥建設	46.7	62	10,726	日清製粉G本社	70	71	107,352	帝国繊維	7.3	7	9,660
長谷工コーポレーション	79.8	76.8	71,961	昭和産業	30	27	13,986	帝人	246	248	97,712
松井建設	11	10.3	11,433	中部飼料	4.8	8.5	6,069	東レ	456	439	422,625
銭高組	7	18	6,246	フィード・ワン	61.9	54.7	6,235	サカイ オーベックス	—	58	11,136
鹿島建設	277	306	213,588	日本甜菜糖	49	49	9,408	住江織物	24	37	8,251
不動産トラ	52.8	51.3	8,669	三井製糖	29	28	13,020	日本バイリーン	13	—	—
鉄建建設	42	43	13,416	森永製菓	62	61	54,717	芦森工業	90	89	7,050
西松建設	70	75	34,350	中村屋	23	23	10,373	アツギ	17	16.1	18,756
三井住友建設	264	255.1	24,744	江崎グリコ	14.7	15.1	82,899	セーレン	15.7	13.2	8,448
大豊建設	19	27	14,553	不二家	43	51	10,200	小松精練	34	33	36,399
前田建設	43	40	33,360	山崎製パン	46	48.4	119,257	ワコールホールディングス	3.8	3.8	27,398
ナカノフード建設	3.5	15.2	5,973	第一屋製パン	—	44	5,500	ホクメディカル	28.2	27.6	15,538
奥村組	60	58	32,422	モロゾフ	24	21	9,051	T S Iホールディングス	39	37	5,883
東鉄工業	8.1	8	22,392	亀田製菓	3.8	3.9	20,436	オンワードホールディングス	42	36	24,732
浅沼組	17	37	7,992	寿スピリッツ	2.2	5.7	13,149	ゴールドウイン	16	2.8	14,700
戸田建設	80	76	39,140	カルビー	23.4	24.1	91,459	デサント	14.9	14.4	17,668
熊谷組	83	97	25,608	森永乳業	60	59	44,368	パルプ・紙 (0.3%)			
北野建設	20	33	8,415	六甲バター	1.7	4	11,488	特種東海製紙	40	38	12,692
三井ホーム	16	13	5,954	ヤクルト	33.9	35.3	167,498	王子ホールディングス	243	229	92,516
矢作建設	10.7	10.1	9,059	明治ホールディングス	18.7	39.4	376,664	日本製紙	29.4	31.2	57,876
ピーエス三菱	—	20.3	7,064	雪印メグミルク	15.4	15.7	54,243	三菱製紙	121	111	7,548
日本ハウスHLDGS	14.1	27.2	10,390	プリマハム	41	46	16,376	北越紀州製紙	40.6	39.5	24,608
大東建託	23.3	24.4	390,278	日本ハム	47	47	113,975	中越パルプ	28	30	6,750
新日本建設	4.7	10.7	9,416	伊藤ハム	36	—	—	大王製紙	27	27.2	32,504
N I P P O	14	15	28,605	丸大食品	37	36	17,280	レンゴー	52	53	33,125
東亜道路	16	27	6,831	米久	1.4	—	—	トーモク	27	24	6,600
前田道路	20	19	34,276	S Foods	4.9	4.6	12,084	ザ・バック	4.9	4.7	12,064
日本道路	21	20	7,860	伊藤ハム米久HLDGS	—	41.9	42,360	化学 (6.4%)			
東亜建設	53	61	10,797	サッポロホールディングス	108	20.2	55,388	クラレ	92.4	94.8	134,900
若築建設	44	92	13,248	アサヒグループホールディングス	118.9	122.7	436,443	旭化成	369	378	302,173
東洋建設	20.6	22.4	9,497	キリンHD	256.4	281	457,889	共和レザー	—	6.3	4,794
五洋建設	72.4	73.1	39,766	宝ホールディングス	51.9	47.3	44,083	昭和電工	410	40.8	51,122
大林道路	9	9.1	5,651	オノンホールディングス	35	60	13,200	住友化学	435	445	203,810
世紀東急	12.3	13.3	6,809	コカ・コーラウエスト	21.1	22.1	55,338	住友精化	14	14	9,506
福田組	11	12	12,468	コカ・コーラフーズジャパン	22.1	23.2	45,286	日産化学	39	36.7	113,586
住友林業	47	44.6	59,808	サントリー食品インター	42.8	45.5	192,010	ラサ工業	—	41	4,264
日本基礎技術	5.2	26.2	8,515	ダイドードリンコ	3.2	3.4	18,564	クレハ	43	45	16,515
日成ビルド工業	24	22	10,208	伊藤園	18.4	19.3	65,330	ティカ	15	14	7,182
ヤマダ・エスバイエルホーム	52	—	—	キーコーヒー	6.4	6.7	12,750	石原産業	113	120	7,920
バコーポレーション	14.7	—	—	日清オイログループ	35	36	16,488	日東エフシー	—	5.8	4,645
パナホーム	25	25	19,600	不二製油グループ	17.1	17.5	34,790	日本曹達	41	41	17,302
大和ハウス	186.9	193	513,283	Jーオイルミルズ	33	32	11,296	東ソー	156	164	100,860
ライト工業	11.2	13.4	15,624	キッコーマン	52	49	156,800	トクヤマ	101	110	38,060
積水ハウス	199	217.3	363,434	味の素	146	138.1	307,134	セントラル硝子	63	66	26,004
日特建設	11.2	18.6	8,872	キユーピー	32	33.9	102,039	東亜合成	35.8	37.2	39,097

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首株数	当期末株数	評価額
大阪ソーダ	千株 29	千株 28	千円 11,032
関東電化	16	16	13,744
デンカ	127	127	57,277
信越化学	106.4	109	766,270
日本カーバイド	26	85	11,730
堺化学	28	28	8,904
エア・ウォーター	51	49	92,071
太陽日酸	75.6	45.9	47,644
日本化学工業	17	32	7,328
日本パーカラジニング	28.1	29.3	39,525
高圧ガス	11	12	7,824
四国化成	10	10	9,160
戸田工業	15	—	—
ステラ ケミファ	4.9	4.4	15,532
保土谷化学	31	34	8,874
日本触媒	46	8.8	54,472
大日精化	28	24	11,232
カネカ	78	82	65,846
三菱瓦斯化学	99	102	70,992
三井化学	272	259	120,694
J S R	56.8	56.8	88,835
東京応化工業	12.2	12.2	36,075
三菱ケミカルHLDGS	369	403.1	244,520
日本合成化学	15	15	13,605
ダイセル	82.2	84.3	102,846
住友バークライト	58	56	28,000
積水化学	135	136	194,072
日本ゼオン	51	51	42,993
アイカ工業	17.9	17.6	46,006
宇部興産	307	327	62,457
積水樹脂	10.2	8.7	13,928
タキロン	17	17	7,667
旭有機材	30	32	6,016
日立化成	28.7	29.5	67,378
ニチバン	—	9	6,669
リケンテクノス	12.4	13.5	6,466
大倉工業	21	20	7,180
積水化成成品	21	18	6,210
群栄化学	19	21	6,174
ダイキョーニシカワ	1.7	8.6	10,397
日本化薬	39	40	42,480
カーリットホールディングス	—	10.2	4,967
日本精化	8.2	7.9	5,988
ADEKA	26.6	27.8	38,058
日油	48	46	45,034
花王	159.6	155	877,300
第一工業製薬	16	25	8,275
三洋化成	20	20	16,920
大日本塗料	46	43	8,600
日本ペイントHOLD	51.1	47.2	158,356
関西ペイント	71	67.9	146,799
中国塗料	18	18	12,888
日本特殊塗料	2.8	6.2	9,225
藤倉化成	13.1	14.5	8,482
太陽ホールディングス	5.1	4.6	15,755
D I C	236	23.7	73,233
サカタインクス	13.5	12.9	14,976
東洋インキSCホールディン	58	57	25,479
T & K TOKA	2.7	6.2	5,604
富士フイルムHLDGS	135.5	139	529,868
資生堂	105.3	116.9	315,337
ライオン	69	71	104,157
高砂香料	22	4.3	11,373
マンダム	6.3	5.8	25,520
ミルボン	4.1	3.9	18,252
ファンケル	14.4	14.2	24,750
コーセー	9.7	9.9	97,812
シーズ・ホールディングス	8.8	8.4	22,680
ポーラ・オルビスHD	6.1	6.2	54,932
エシアホールディングス	4.4	4.1	12,976
エステー	3.8	—	—
コニシ	5.1	10.6	12,349
長谷川香料	7.6	7.9	14,646

銘柄	期首株数	当期末株数	評価額
星光PMC	千株 2.1	千株 5.6	千円 6,406
小林製薬	9.6	18.2	93,548
荒川化学工業	6.7	6.2	7,440
メック	6.3	—	—
日本高純度化学	3.5	3.1	7,012
タカラバイオ	—	12.2	20,056
J C U	1.9	2.3	8,441
新田ゼラチン	6	6.9	4,836
デクセリアルズ	12.1	17.8	15,806
アース製薬	4.3	4.5	20,385
イハラケミカル	10.1	10.3	8,713
大成ラミック	3.5	2.8	8,033
クミアイ化学	13.3	13.5	6,844
日本農薬	14.1	15.1	7,504
アキレス	73	63	8,757
有沢製作所	11.6	11.1	5,649
日東電工	45.7	47.4	313,882
藤森工業	5.4	5.5	11,918
前澤化成工業	7.2	7.4	7,622
ジェイ エス ピー	4.1	4.3	9,378
エフビコ	5.4	5.3	28,408
天馬	5.6	5.4	8,440
信越ポリマー	14.7	14.3	9,466
東リ	28	22	6,732
ニフコ	13.6	11.6	64,148
日本バルカー	36	33	9,042
ユニ・チャーム	119.6	124	309,256
医薬品 (5.4%)			
協和発酵キリン	71	73	115,121
武田薬品	222.3	241.9	1,123,383
アステラス製薬	664.4	662.5	1,039,793
大日本住友製薬	42.5	43.8	78,445
塩野義製薬	92.5	89.3	447,393
田辺三菱製薬	67.9	69.8	145,184
あすか製薬	8.6	9.4	16,224
日本新薬	14	14.1	71,346
中外製薬	59.1	61.4	213,979
科研製薬	21	10.5	63,315
エーザイ	78.1	75.3	480,188
ロート製薬	27.1	30.3	51,661
小野薬品	26.8	140	363,580
久光製薬	16.5	18.9	99,225
持田製薬	4.1	4.3	34,916
参大製薬	108.6	111.6	159,699
扶桑薬品	32	28	7,756
日本ケミファ	12	13	5,304
ツムラ	18.6	19.3	54,908
日医工	14.3	14.6	26,864
キッセイ薬品工業	10.8	10.1	26,047
生化学工業	12.1	12.4	19,120
栄研化学	5.8	6	16,692
鳥居薬品	4.5	4.7	9,479
J C Rファーマ	5.2	5.4	13,597
東和薬品	3.3	3	12,420
富士製薬工業	1	2.7	6,901
沢井製薬	9.4	10.4	72,488
ゼリア新薬工業	12.7	13.1	21,064
第一三共	199.3	205.9	497,557
キョーリン製薬HD	15.9	16.1	35,307
大幸薬品	3.1	4.6	7,162
ダイト	3.5	3.9	8,521
大塚ホールディングス	126.9	131.7	596,074
大正製薬HD	14.1	14.5	146,595
ペプチドリム	—	10.3	50,624
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	81.3	64.2	5,200
昭和シェル石油	58.3	57.8	51,268
コスモ石油	169	—	—
ニチレキ	9	9	6,354
東燃ゼネラル石油	88	90	86,310
コスロ化学	4.8	4.8	6,710
ピービー・カストロール	—	4.3	5,396
富士石油	17.9	19.5	5,889

銘柄	期首株数	当期末株数	評価額
出光興産	千株 28.1	千株 31.2	千円 61,869
J Xホールディングス	650.2	712.9	280,098
コスモエネルギーHLDGS	—	18.6	21,948
ゴム製品 (0.9%)			
横浜ゴム	34.8	36.4	59,441
東洋ゴム	27.5	27.5	37,345
ブリヂストン	199.9	206.1	747,730
住友ゴム	52.6	55.8	86,322
藤倉ゴム	6.7	—	—
オカモト	25	20	24,280
ニッタ	6.4	5.9	13,764
住友理工	11.3	13.3	12,701
三ツ星ベルト	17	16	13,040
パンドー化学	25	25	11,700
ガラス・土石製品 (0.9%)			
日東紡績	48	43	14,061
旭硝子	311	301	194,446
日本板硝子	306	315	25,830
日本山硝子	35	30	5,130
日本電気硝子	119	123	63,714
住友大阪セメント	115	123	56,826
太平洋セメント	373	379	110,668
日本ヒューム	8.5	8.1	5,094
日本コンクリート	12.9	23.9	7,958
アジャパイルHD	10.2	16.6	7,038
東海カーボン	59	54	15,012
日本カーボン	35	36	6,156
東洋炭素	3.7	4.1	5,313
ノリタケ	41	37	8,621
T O T O	88	44.7	169,636
日本硝子	75	77	162,701
日本特殊陶業	50.6	51.9	95,184
MA R UWA	2	2.8	10,276
品川フラスコトリーズ	22	27	5,292
フジミコンポレテッド	7	5.7	7,980
ニチアス	29	31	26,443
ニチハ	8.9	8.9	19,499
鉄鋼 (1.2%)			
新日鐵住金	2,533	274.3	538,999
神戸製鋼所	1,021	1,107	99,630
合同製鐵	40	41	7,134
J F Eホールディングス	150.8	164.7	237,662
日新製鋼	25.1	27.3	35,735
東京製鐵	30.7	33.8	23,727
共栄製鋼	6.7	7.1	13,298
大和工業	12.9	13.3	37,865
東京製鋼	15	24	9,048
大阪製鐵	3.7	4.2	7,156
淀川製鋼所	42	9.3	24,728
東洋鋼板	16.5	17.3	5,138
丸一鋼管	17.2	20.1	68,038
大同特殊鋼	99	101	46,056
日本高周波	—	64	4,608
日本冶金工	48.6	72.8	10,119
山陽特殊製鋼	37	38	21,318
愛知製鋼	36	38	19,912
日立金属	59.7	68.7	81,615
大平洋金属	40	48	13,680
新日本電工	37.1	40.4	6,585
栗本鉄工所	39	35	6,300
三菱製鋼	47	47	7,708
非鉄金属 (0.9%)			
日本軽金属HD	161	145.9	31,514
三井金属	170	161	33,327
東邦亜鉛	39	43	13,459
三菱マテリアル	370	378	107,352
住友鉱山	163	167	217,100
DOWAホールディングス	71	80	54,960
古河機金	105	103	16,171
大阪チタニウム	6.2	6.8	9,370
東邦チタニウム	10.9	11.9	8,663
U A C J	70	88	25,520
古河電工	185	194	50,052

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
住友電工	222.7	241.1	347,063	クボタ	284	293.8	430,710	富士電機	156	175	79,800
フジクラ	86	84	46,872	三菱化工機	24	34	7,208	東洋電機製造	16	38	11,780
昭和電線HLDGS	85	98	6,664	月島機械	11.8	11.8	12,413	安川電機	69.7	72.2	107,794
タツタ電線	12.6	16.7	5,794	帝国電機製作所	5.5	8	6,328	シフオニア テクノロジー	46	47	7,802
リョービ	39	39	16,965	新東工業	15.5	14.6	12,074	明電舎	59	56	18,424
アールステイ	7.5	9.4	9,672	渋谷工業	5.5	5.5	9,955	山洋電気	14	17	9,265
アサヒHD	9.6	9.4	16,384	アイチ コーポレーション	11.6	10	7,090	デンコ	5.7	6.2	6,175
金属製品 (0.6%)				小森コーポレーション	15.3	15.2	19,273	東芝テック	42	43	17,028
稲葉製作所	1.5	4.5	5,530	鶴見製作所	5.3	5.1	7,507	マブチモーター	16.1	16.6	87,814
宮地エンジニアリング	11	56	7,952	鶴見精密	14	21	6,552	日本電産	62.5	70.8	633,447
トーカロ	4.6	5.3	11,803	荏原製作所	124	135	74,790	東光高岳	3	3.4	6,732
SUMCO	45.7	48.8	40,162	西島製作所	7.7	7.7	7,915	ダブル・スコープ	—	5.6	11,922
川田テクノロジー	1.5	1.5	6,675	北越工業	5.9	14.3	9,295	ダイヘン	33	35	18,480
東洋製罐グループHD	42.3	41.1	75,624	ダイキン工業	82.4	85	796,280	田淵電機	5.9	16.2	5,475
ホッカンホールディングス	24	20	6,860	オルガノ	15	14	5,670	JVCケンウッド	45.5	47.7	11,829
横河ブリッジHLDGS	12.3	12.4	13,416	トーヨーカネツ	42	42	8,526	ミマキンゾーアリング	2	—	—
三和ホールディングス	57.1	61.4	58,084	栗田工業	32.3	35.2	80,537	第一精工	2.5	3.8	3,689
文化シャッター	19	18.2	13,650	椿本チエイン	31	34	26,146	日新電機	15	14.6	23,827
三協立山	8.4	8.3	13,097	日本コンベヤ	25	—	—	大崎電気	11	12	11,700
アルインコ	—	6.8	6,120	アネスト岩田	12.2	11.6	11,565	オムロン	60.4	65.7	237,834
LEXILEグループ	87.1	83.2	180,211	ダイフク	28.8	31.2	54,350	日東工業	9.3	9.6	12,873
ノーリツ	11.8	11.8	24,083	加藤製作所	14	21	8,610	IDEC	8.5	9.3	8,593
長府製作所	6.5	5.9	15,198	油研工業	—	54	9,072	ジーエス・ユアサ コーポ	113	114	47,196
リンナイ	10.9	11.2	102,256	タダノ	28	28	25,648	サクサホールディングス	9	—	—
岡部	13.2	13.7	11,343	フジテック	17.2	17	19,329	メルコホールディングス	4	4.2	10,802
ジーテクト	4	7.3	13,329	CKD	16.8	17.3	20,344	日本電気	729	797	204,829
東プレ	12.4	12.2	24,766	キトー	7.8	9.3	8,332	富士通	544	560	300,272
高周波熱錬	12.4	12.8	9,241	平和	18.5	18	41,202	沖電気	209	260	35,880
東京製鋼	50	49	7,938	理想科学工業	7.5	6.7	10,867	電気興業	20	19	9,443
パイオラックス	3.4	3.3	19,833	SANKYO	15.5	15.3	53,091	サンケン電気	31	36	11,412
日本発条	51.5	53.3	51,381	日本金銭機械	6.1	6.7	9,279	アイホン	4.4	4.1	6,535
三益半導体	6.5	5.5	6,319	マルスエンジニアリング	4.7	3.9	7,683	ルネサスエレクトロニクス	28.9	33	20,427
機械 (5.0%)				福島工業	3.9	4.2	13,398	セイコーエプソン	76.5	86.2	163,780
日本製鋼所	86	102	47,532	ダイコク電機	3.5	3.4	5,168	ワコム	48	48.4	15,052
三浦工業	25.5	27.2	54,073	竹内製作所	6.3	12.2	17,019	アルバック	9.9	10.9	31,588
タクマ	20	23	21,045	アマノ	19.8	18	28,404	アクセル	4.5	4.9	3,547
ツガミ	19	20	10,460	JUKI	9.4	10.4	7,280	EIZO	5.7	6.1	16,012
オーコム	40	40	30,240	サンデンホールディングス	38	37	10,767	ジャパンディスプレイ	114.7	110.1	18,276
東芝機械	35	34	11,254	蛇の目ミシン	67	12	6,552	日本信号	16.1	16.6	13,612
アマダホールディングス	89	85.8	91,634	マックス	10	10	11,540	京三製作所	17	19	7,011
アイダエンジニア	14.3	16.9	13,148	グローリー	18.1	19.7	64,616	能美防災	8	7.1	10,224
滝澤鉄工所	29	81	10,692	新晃工業	5.3	5.3	6,799	ホーチキ	2.6	5.6	5,964
富士機械製造	20.2	17.9	20,495	大和冷機工業	9.9	10.8	9,622	エレコム	2.5	5.9	12,443
牧野フライス	31	31	19,158	セガミホールディングス	60.8	60.9	86,782	日本無線	16	21	5,649
オーエスジー	27.3	27.4	52,799	日本ビストンリシング	34	7.5	11,227	パナソニック	693.6	666.3	678,293
旭ダイヤモンド	17.3	17.2	14,035	リケン	30	31	10,416	シャープ	479	—	—
DMG森精機	38.3	33.9	34,510	T P R	7	7.5	20,655	アンリツ	34	34.6	19,583
ソデック	10.4	15.3	11,061	ホシザキ	12.3	12.9	112,746	富士通ゼネラル	18	18	36,954
ディスコ	7.1	7.7	91,630	マックス	6.6	6	6,708	日立国際電気	16	14	25,494
日東工器	4.1	4.1	9,290	日本精工	117.1	118.7	124,397	ソニー	397.6	412.5	1,369,500
OKK	—	42	4,158	NTN	134	145	51,765	TDK	34.1	34.9	251,629
島精機製作所	9.1	8.8	22,290	ジェイテクト	60.6	59.8	88,563	帝国通信工業	—	46	6,854
NCホールディングス	—	3.2	2,672	不二越	54	54	19,170	ミツミ電機	22	24.9	14,367
日版製作所	9.4	9.4	7,444	日本トムソン	22	22	8,250	タムラ製作所	26	27	10,098
やまびこ	2.7	12.1	9,934	THK	37.4	37.9	72,957	アルプス電気	46	50.7	124,975
ナブテスコ	36.1	31.2	86,486	ユーシン精機	3.2	3.1	7,272	パイオニア	92.4	97.4	21,622
三井海洋開発	6.1	7.4	12,143	イーグル工業	8.8	7.7	9,871	日本電波工業	7.7	8.1	6,650
SMC	17.7	18.2	520,338	日本ビラー工業	8.5	7.5	7,005	日本トリム	1.1	1.9	10,944
新川	4.4	11.5	7,348	キッツ	27.3	29.2	16,030	ローランド ディー・ジー	2.8	3.6	8,154
ソコカワミクロン	14	12	6,828	日立工機	15.4	7.2	5,133	フオスター電機	6.4	7.7	14,753
ユニオンツール	3.1	2.9	7,571	マキタ	36.7	37.5	267,000	クラリオン	34	34	10,234
オイレス工業	7.5	7.7	12,681	日立造船	48.7	46.7	24,003	SMK	20	22	7,370
日精エースビー	2.6	2.8	4,494	三菱重工業	948	1,032	448,300	ヨコオ	—	8.1	4,900
サトーホールディングス	7.8	8.4	18,001	IHL	407	446	126,218	東光	19	—	—
日精樹脂工業	5.5	7.2	4,845	電気機器 (12.3%)				ホシデン	18.7	19.6	14,974
小松製作所	290.2	299.1	684,490	日清紡ホールディングス	—	30.2	30,864	ヒロセ電機	9.5	9.2	119,324
住友重機械	163	176	88,704	イビデン	36.6	36.1	47,471	日本航空電子	17	17	26,656
日立建機	26.9	26.7	52,839	コニカミノルタ	132.2	144.5	125,137	TOA	7.4	7.9	7,102
巴工業	3.8	3.8	5,779	ブラザー工業	72.4	73.9	126,812	日立マクセル	10.1	9.8	15,346
井関農機	65	66	16,302	ミネベア	85	94	89,018	古野電気	9	10.1	5,423
TOWA	3.2	8	9,536	日立	1,358	1,482	701,578	ユニデンホールディングス	26	94	14,194
丸山製作所	—	27	4,509	東芝	1,189	1,240	391,840	アルパイン	14.2	14.4	17,049
北川鉄工所	33	47	7,802	三菱電機	566	619	775,916	スミダコーポレーション	8.2	—	—

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
アイコム	千株 4.3	千株 4.2	千円 8,110	トヨタ自動車	千株 782	千株 742.2	千円 4,417,574	共立印刷	千株 -	千株 -	千円 11,673
船井電機	6.7	6.7	5,514	日野自動車	81.7	82.1	89,489	フランスベッドHLDGS	55	55	38.4
横河電機	57.9	58.7	77,660	三菱自動車工業	206.8	233.8	107,548	パロットコーポレーション	10.2	10.3	9.4
新電元工業	25	23	9,085	エフテック	6	4.9	5,997	トッパン・フォームズ	11.3	11	41,045
アズビル	17.6	18.2	54,108	武蔵精密工業	7.1	6.5	15,496	フジールインストアショナル	7.2	7.1	11,440
日本光電工業	23.7	24.2	55,176	日産車体	24.8	24.9	22,459	タカラトミー	24.2	20.1	29,110
共和電業	-	13.7	4,479	新明和工業	24	26	16,978	廣済堂	3.6	-	19,637
堀場製作所	10.8	10.7	52,162	極東開発工業	11.7	12.3	13,751	大建工業	33	28	10,528
アドバンテスト	41.2	40.3	54,203	日信工業	10.8	13.1	20,108	凸版印刷	159	160	148,640
エスベック	8.1	7.1	9,123	トビー工業	55	52	10,868	大日本印刷	167	168	171,696
パナソニックデバイス	-	8.3	4,556	ティラド	33	35	6,720	図書印刷	14	15	7,140
キーエンス	12.8	13.3	977,018	曙ブレーキ	30.7	43.2	8,899	共同印刷	26	26	8,320
日置電機	4.1	3.8	7,163	タチエス	9.9	9.9	16,849	日本写真印刷	10.3	10.3	24,720
シスメックス	43.7	45.6	334,704	NOK	27.4	27.9	56,748	宝印刷	6.4	7.8	10,280
メガチップス	8.1	7.7	14,245	フタバ産業	22	21.8	10,856	アシックス	52.8	54.2	113,494
OBARA GROUP	3.9	3.9	14,566	KYB	66	66	27,786	ツミミ	3.4	3.5	5,824
コーセル	9.1	9.4	10,979	シロキ工業	6	-	-	小松ウオール工業	2.7	2.6	4,199
オプテックス	4.6	4.7	10,904	大同メタル工業	9.4	9.2	10,304	ヤマハ	42.2	42.8	136,318
千代田インテグレ	3	3.6	6,966	プレス工業	32.2	32.9	14,081	河合楽器	3.2	3	5,085
レーザーテック	7.3	7.9	14,528	カルソニックカンセイ	45	45	42,390	クリナップ	7.2	9.1	7,534
スランレー電気	40.4	41.2	110,951	太平洋工業	14.7	14	15,974	ビジョン	32.4	33.2	94,254
岩崎電気	26	64	8,896	ケーヒン	13.6	13.2	21,463	キングジム	3.6	8.5	7,029
ウシオ電機	34.3	35.2	39,776	河西工業	9.1	8.3	8,582	リント印刷	12.9	12.5	25,612
日本セラミック	4.1	3.9	7,277	アイシン精機	51.1	59	275,825	TASAKI	0.7	-	-
日本デジタル研究所	6	6	8,556	富士機工	4.5	10.3	3,440	イトーキ	14	13.8	8,859
古河電池	6	-	-	マツダ	168.3	182.9	289,164	任天堂	34.8	36.1	986,071
山一電機	7.8	11.6	9,419	ダイハツ	65	-	-	三菱鉛筆	4.6	4.6	21,620
図研	6.7	8.9	9,033	今仙電機製作所	6	7.4	6,334	タカラスタンダード	24	23	20,332
日本電子	27	27	10,287	本田技研	509.6	523.6	1,550,379	コクヨ	30.9	30.2	42,310
カシオ	56.9	59.5	83,716	スズキ	118.1	107.9	362,004	ナカバヤシ	-	18	4,212
ファナック	59	59	997,985	富士重工	192.4	184.8	705,012	グローブリッド	-	3.7	6,286
日本シイエムケイ	20.6	-	-	ヤマハ発動機	79.5	81.2	159,476	岡村製作所	23	20.7	19,809
エンプラス	2.7	3.2	9,152	ショーワ	14.6	15.9	8,713	美津濃	34	32	16,224
大真空	16	-	-	TBK	11.3	25.4	10,287	アデランス	8.2	13	5,512
ローム	27.7	28.2	145,794	エクセディ	8	7.2	18,309	電気・ガス業 (1.9%)	-	-	-
浜松ホトニクス	43.8	44.8	138,656	豊田合成	18.5	19	45,448	東京電力HD	479.5	494.9	207,363
三井ハイテック	9.7	11.1	7,514	愛三工業	11.1	11.2	8,825	中部電力	173.2	179.1	269,276
新光電気工業	23.8	22.8	12,790	ヨロス	6.1	5.8	8,595	関西電力	231.1	241.3	222,285
京セラ	92.9	95	473,670	エフ・シー・シー	9.2	9.8	21,805	中国電力	76.9	78.3	105,783
太陽誘電	30.9	29.2	30,076	シマノ	22.7	23.6	364,384	北陸電力	54.8	55.4	70,690
村田製作所	59.4	61.8	825,030	タカタ	8.5	-	-	東北電力	140.6	145.3	199,642
ユージン	11.3	15.2	10,548	テイ・エス テック	12.3	13.4	34,478	四国電力	50.9	51.6	54,902
双葉電子工業	10.1	10.3	16,706	ジャムコ	1.8	4.2	8,568	九州電力	124.7	130.2	124,210
北陸電気工業	36	86	10,062	精密機器 (1.5%)	-	-	-	北海道電力	53.4	55.2	48,576
ニチコン	19.2	19.3	15,420	デルモ	86.6	89.9	352,408	沖縄電力	6.3	9.6	22,310
日本ケミコン	49	55	9,020	日機装	19.8	22.4	19,555	電源開発	40.2	48.8	124,391
KOA	9.4	9.1	7,343	島津製作所	68	74	112,480	東京瓦斯	690	649	305,614
小糸製作所	34	34.7	165,345	JMS	24	20	5,320	大阪瓦斯	588	594	253,816
ミツバ	11.2	10.3	13,019	クボテック	0.6	-	-	東邦瓦斯	141	145	137,025
スター精密	11.7	11.9	14,327	ブイ・テクノロジー	0.7	1.7	18,615	北海道瓦斯	28	34	9,452
SCREENホールディングス	57	60	75,240	東京計器	28	42	6,762	広島ガス	-	23.3	7,479
キャノン電子	5.4	6	9,210	東京精密	11.1	11.5	31,452	西部瓦斯	72	67	16,683
キャノン	305	311	902,522	マニ	5.4	7.3	15,957	静岡ガス	17.6	18.7	14,866
リコー	168.9	187.3	173,065	ニコン	105.3	107.5	160,605	メタウォーター	2.4	3.9	10,592
MUTOHホールディングス	10	-	-	トプコン	17.5	20.2	25,896	陸運業 (4.3%)	-	-	-
東京エレクトロン	47.7	47.9	439,434	オリンパス	84.1	87.5	314,562	SBSホールディングス	5.9	7.7	7,099
輸送用機器 (9.7%)	-	-	-	理研計器	7	5.9	6,537	東武鉄道	303	309	158,517
トヨタ紡織	20.6	20.5	46,412	タムロン	5	5.4	8,823	相鉄ホールディングス	100	98	50,666
鬼怒川ゴム	17	-	-	HOYA	134.4	132.3	535,285	東京急行	306	339	264,759
ユニプレス	11.4	12.4	22,047	ノーリツ銅機	8.8	10.5	6,909	京浜急行	151	155	158,720
豊田自動織機	50.9	51.9	251,974	リズム時計	72.4	70.2	37,627	小田急電鉄	181	186	209,994
モリタホールディングス	11.5	11	14,707	大研医器	39	37	6,660	京王電鉄	159	162	143,694
三桜工業	12	10.4	6,531	メニコン	5.5	6.7	5,071	京成電鉄	86	87	111,447
デンソー	139.7	143.1	592,004	松風	1.8	4.1	10,807	富士急行	17	17	19,992
東海理化電機	15.4	16.7	31,930	セイコーHD	4.6	4.4	5,689	新京成電鉄	21	25	9,750
三井造船	230	231	32,571	ニプロ	38.3	43.1	56,030	東日本旅客鉄道	103.8	106.6	956,628
川崎重工業	411	449	139,190	その他製品 (2.0%)	-	-	-	西日本旅客鉄道	54.4	55.9	348,145
名村造船所	17	18.4	13,064	パラマウントベッドHD	6.4	6.3	24,192	東海旅客鉄道	50.7	52.1	909,926
日本車輛	23	30	7,800	前田工業	7.2	8	9,040	西武ホールディングス	44.8	61.4	104,441
ニチュニマフウォークリフト	8.2	-	-	永大産業	14	14	5,824	鴻池運輸	7.8	9.1	12,239
近畿車輛	-	13	3,055	アートネイチャー	5.6	7.1	4,693	日本郵船	76	76	37,164
日産自動車	792.9	793.9	801,045	バンダイナムコHLDGS	62.7	59.6	178,621	ハマキョウレックス	4.6	5.5	9,416
いすゞ自動車	178.5	167.3	204,775	-	-	-	-	サカイ引越センター	1.2	3	7,497

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
近鉄グループHLDGS	千株	千株	千円	LINE	千株	千株	千円	マクニカ・富士エレクトロニクス	千株	千株	千円
阪急阪神HLDGS	562	577	242,340	野村総合研究所	—	9.5	41,895	バイタルKSKHD	10.8	10.9	12,088
南海電鉄	373	77.4	265,869	インテックホールディングス	31.5	40.5	140,535	UKCホールディングス	12.7	11.1	11,266
京阪ホールディングス	129	130	63,830	フジ・メディア・HD	4.5	4.3	6,888	TOKAIホールディングス	4.6	4.3	7,030
神戸電鉄	128	128	90,624	オービック	58.2	58.7	77,894	三洋貿易	30.1	29.3	19,338
名古屋鉄道	28	27	9,990	ジャストシステム	19.3	19.9	103,679	シブヘルスケアHD	5.5	5.3	6,444
山陽電鉄	194	209	111,188	ヤフー	10.2	12.9	11,055	小野建	10.6	11.8	34,833
日本通運	25	27	14,310	トレンドマイクロ	400.4	424.3	173,538	佐島電機	6.6	6.5	7,839
ヤマトホールディングス	219	221	111,384	日本オラクル	27.6	28.1	99,333	ナガイレベン	—	14.2	9,684
山九	99.4	106	257,845	フューチャー	8.8	9.6	57,984	三菱食品	8.6	9.3	19,211
丸全昭和運輸	69	76	43,548	CAC HOLDINGS	9.8	10.2	7,425	松田産業	5.9	6.4	19,392
センコー	24	24	8,760	オービックビジネスEC	6.6	9.7	7,924	第一興商	5.6	5.9	7,675
トナミホールディングス	26	27	18,387	伊藤忠テクノソリューションズ	4	3.2	14,896	メディカルHD	—	10.2	40,392
ニッコンホールディングス	7	16	4,128	アイティフォー	13.2	13.3	34,486	アズワン	55.6	56.5	97,180
福山通運	18.4	17.6	38,227	大塚商会	14.8	24	13,896	シモジマ	4.6	4.8	20,424
セイノーホールディングス	32	34	20,468	サイボウズ	15.1	15.8	75,919	ドウシシャ	6.5	6.3	6,356
神奈川中央交通	43.7	40	43,840	電通国際情報S	—	27.5	13,282	丸田電気	7.9	7.4	15,569
日立物流	17	13	9,191	ウェザーニューズ	5.8	4.5	8,433	ハピネット	10.1	11.2	21,772
丸和運輸機関	11.9	12.6	26,182	C I J	2.5	2.5	7,675	エクセル	3	11.8	6,690
海運業 (0.2%)	0.3	—	—	WOWOW	—	14.1	6,387	I DOM	4.4	6.5	6,682
日本郵船	479	507	94,302	フュージョンパートナー	3.3	3.5	9,737	進和	2	4.2	5,031
商船三井	298	283	65,939	イマジカ・ロボットHD	1.6	—	—	シークス	18.1	16.6	9,412
川崎汽船	255	257	65,792	ネットワンシステムズ	2.9	—	—	伊藤忠	—	4.9	6,992
NSユナイテッド海運	30	34	4,658	マーベラス	25.1	26.6	18,779	丸紅	4.1	4	16,020
飯野海運	34.3	34.9	12,773	イーベックス・グループHD	10.6	11.6	8,758	長瀬産業	465.3	452.9	560,690
空運業 (0.6%)				日本ユニシス	11.5	11.2	15,489	高島	484.1	559.5	284,785
日本航空	107.5	110.4	336,499	兼松エレクトロニクス	17.7	16.8	21,386	豊田通商	—	66	10,626
ANAホールディングス	1,112	1,072	304,448	東京放送HD	6.6	5.2	9,729	三井物産	30.7	26	31,616
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				日本テレビHLDGS	34.4	33.7	49,471	丸紅	5	4.7	6,669
トランコム	1.9	2	11,680	朝日放送	51.2	51.9	85,790	豊田通商	62.3	62.1	147,363
日新	31	29	8,497	テレビ朝日HD	1.4	—	—	三井物産	17.4	13.2	4,224
三菱倉庫	38	39	59,397	スカパーJ SATHD	16	16	28,784	日本紙パルプ	121	129	19,479
三井倉庫HOLD	41	39	11,583	テレビ東京HD	48.9	46.7	22,135	日立ハイテクノロジーズ	470.2	520.7	699,560
住友倉庫	43	35	18,340	コネクト	5.5	6.2	13,410	カメイ	19	28	9,212
渋沢倉庫	21	22	6,138	日本通信	6.7	6.7	9,011	東都水産	19.4	19.5	74,490
東陽倉庫	26	25	5,750	日本電信電話	25.6	46	8,234	スターゼン	9.6	8.5	6,927
日本トランスシティ	20	18	6,372	KDDI	437.5	444	2,048,616	山善	—	28	4,508
安田倉庫	7.3	7.1	4,189	光通信	569.3	6.8	62,220	住友商事	30	2.5	11,975
東洋埠頭	31	79	12,324	NTTドコモ	5	6.8	62,220	内田洋行	23.3	23.4	17,994
上組	65	64	56,896	エムティーアイ	431.2	429.5	1,099,090	三菱商事	325.1	355.2	395,692
キユーソー流通システム	0.9	2.9	6,594	GMOインターネット	5.5	10.6	6,646	第一興業	20	19	8,075
郵船ロジスティクス	6.2	6.7	6,586	学研ホールディングス	19.9	22.2	29,015	西華産業	426.9	431.9	917,355
近鉄エクスプレス	5.2	11.1	14,407	ゼンリン	14.3	18.3	25,107	菱洋エレクトロ	19	18	9,270
情報・通信業 (8.4%)				松竹	32	28	8,456	ユアサ商事	15.8	16.3	29,454
NECネットエスアイ	7.3	7	12,159	NTTデータ	9.7	8.4	14,439	西華産業	26	29	7,627
システム	9.7	7.4	13,112	スクウェア・エニックス・HD	39	38	43,890	菱電商事	7.9	7.7	9,216
デジタルアーツ	2.3	4.2	10,718	シーイーシー	40	40.9	135,788	岩谷産業	5.7	6.1	13,212
新日鉄住金SOL	5.2	10.2	17,890	カブコム	23	22	17,622	すてきなグループ	30	54	9,558
TIS	—	19.4	48,150	ジャステック	34.7	36.4	189,644	昭光通商	59	59	35,046
ITホールディングス	19.2	—	—	S C S K	6.9	7.2	15,940	阪和興業	10.8	10.1	9,625
電算システム	—	3.4	5,035	アイネス	22	24.4	78,324	カナデン	14	13	8,762
グリー	34.9	36.3	22,360	T K C	8.7	10.7	10,946	菱電商事	60	67	38,994
コーエーテックモHD	13.9	14	26,236	富士ソフト	13.8	14.2	55,664	岩谷産業	37	36	4,968
三菱総合研究所	3.3	2.9	9,309	N S D	9.7	10.1	11,524	三菱石油	44	—	—
ファインテックス	3.2	—	—	コンナホールディングス	5.9	5.8	17,179	稲畑産業	17	15	9,615
K L a b	8.1	11	6,688	J B C Cホールディングス	9	9	24,723	ワキタ	15.4	15.2	14,835
ポルトウイン・ピットル	3.2	9.1	7,562	ミロク情報サービス	5.9	5.8	17,179	東邦ホールディングス	13.5	12.8	9,587
ネクソン	54.2	56.1	83,252	ソフトバンクグループ	8.7	9	24,723	サンゲツ	19.6	18.7	39,681
アイスタイル	1.8	11	8,404	卸売業 (4.2%)	15.7	17.5	15,700	ミツウロコグループ	19.6	20	37,100
イチチーム	1.7	4.4	9,605	JALUX	2.4	26.1	99,832	シナネンホールディングス	14.2	10.9	5,831
en i s h	0.9	—	—	あらた	10.4	10	6,640	伊藤忠エネクス	19	16	6,304
コプロ	14.9	16.4	24,714	フィールズ	—	6.6	11,431	サンリオ	15.7	17.5	32,847
オールドプラス	1.1	—	—	双日	295.6	32.7	2,117,979	サンワ テクノス	5.6	5.9	4,200
ブロードリーフ	5.3	7.8	8,572	アルフレッサホールディングス	—	3	5,001	リョーサン	9.9	9.1	28,346
ハーツユナイテッドグループ	1.3	—	—	横浜冷凍	4.1	3	6,813	新光商事	8.6	7.7	7,869
ブイキューブ	1	—	—	アルゴニック	2.3	4.7	5,978	トーホー	4.6	3.6	8,254
ティガー	6.6	6.2	8,785	神戸物産	383.8	366.7	92,775	三信電気	8.6	9.6	8,448
豆蔵ホールディングス	3.1	—	—	あいホールディングス	65.5	71.4	151,153	東陽電機	9.4	9.6	8,448
ガバ・オンライン・エンター	—	133.3	32,125	ダイワボウHD	17.5	15.7	15,700	モスフード サービス	10.3	10.4	10,452
GMOペイメントゲートウェイ	5.4	5.2	24,830		4.4	5.3	7,186		7.3	7.7	24,293
インターネットインテグ	9.9	9.9	18,572		2	4.3	9,558		6.1	6	7,206
S R Aホールディングス	2.1	4.3	9,240		9.8	10.8	24,915		9.7	9.4	21,902
朝日ネット	14.3	15	6,465		67	58	13,514		3.2	—	—
g u m i	4.4	8.1	6,212						49	77	10,164

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首株数	当期末株数	当期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	当期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	当期末評価額
日鉄住金物産	千株 34	千株 47	千円 16,826	サイゼリヤ	千株 8.9	千株 9.8	千円 22,383	三井住友トラストHD	千株 1,237	千株 1,195	千円 409,287
トラスコ中山	6.9	6.9	35,742	V Tホールディングス	14.7	21.7	9,699	三井住友フィナンシャルG	422.8	461.2	1,585,144
オートバックスセブン	19.8	21.5	31,820	ユナイテッドアローズ	7.4	8.3	20,351	第四銀行	70	66	26,202
加藤産業	8.5	8.2	18,163	ハイデイ日高	4.9	5.6	12,829	北越銀行	68	64	14,272
イノテック	—	19.1	9,416	京都きもの友禅	8.1	8.5	7,539	西日本シティ銀行	194	178	36,668
イエローハット	5.9	5.8	11,663	コロナフイ	20	19.3	36,477	千葉銀行	216	218	128,402
日伝	2.6	2.9	8,244	香番屋	2.8	5.4	17,604	横浜銀行	375	—	—
因幡電機産業	8.3	6.8	23,698	スキホールディングス	9.9	10.2	54,264	常陽銀行	197	198	93,456
ミスミグループ本社	63.3	64	114,624	スクロール	—	19.8	7,385	群馬銀行	128	122	57,462
スズケン	25.3	25.8	83,592	ヨンドシーホールディングス	4.9	4.8	10,790	武蔵野銀行	9	8.9	24,172
ジェスコ	4.9	4.9	4,125	ユニ・ファミリマートHD	18.5	25,600.6	173,572	千葉興業銀行	13.9	19	7,543
小売業 (4.8%)				木曽路	6.9	7.9	17,925	筑波銀行	27.7	27.4	8,192
ローソン	20.7	22	172,260	サトレストランジシステムズ	—	10.4	8,663	七十七銀行	92	87	36,279
サンエー	4.5	4	19,360	千趣会	12.9	14.2	9,443	青森銀行	50	43	13,330
カワチ薬品	5.3	4.9	11,686	ケーヨー	14.7	13.2	6,679	秋田銀行	43	40	12,280
ユーピーシー・マート	8	7.6	50,616	上新電機	13	15	12,735	山形銀行	35	34	14,484
ハードオフコーポレーション	—	6.9	7,721	日本瓦斯	9.3	9	28,080	岩手銀行	4	4.1	16,687
アスクル	5.9	7.2	26,640	ロイヤルホールディングス	10.4	10	17,180	東邦銀行	52	49	17,444
ゲオホールディングス	12	11.2	14,784	いなげや	6.9	7.6	10,396	東北銀行	—	89	12,994
アダストリア	—	5	10.9	島忠	14	14.6	35,127	みちのく銀行	32	30	6,090
くらこコーポレーション	3.8	3.6	16,884	デコダ	6.9	6.8	16,401	びくおかフィナンシャルG	227	246	102,582
キャンドー	4.9	5.6	9,010	ライフコーポレーション	4	4.1	12,648	静岡銀行	164	165	136,455
パルグループHLDGS	3.7	3.7	8,558	リンガーハット	6.3	5.8	13,258	十六銀行	71	69	20,286
エディオン	27.6	24.8	21,377	AOKIホールディングス	13.6	13.4	15,356	スルガ銀行	57.7	56.6	139,405
あみやき亭	1.4	1.5	5,490	オークワ	10	10	9,370	八十二銀行	99	97	50,925
ひらまつ	11	12.6	7,320	コメリ	9.8	8.7	20,610	山梨中央銀行	37	34	14,280
ゲンキョー	0.9	1.7	6,196	青山商事	14.1	10.9	37,877	大垣共立銀行	72	75	26,175
ハニーズ	6	6.7	8,227	しまむら	6.4	6.7	79,194	福井銀行	51	51	13,209
アルペン	5.3	5.5	10,081	高島屋	82	84	68,796	北國銀行	60	59	18,408
クオール	6.8	6.8	9,533	松屋	12	12.5	9,000	清水銀行	2.6	2.7	7,360
ジェイアイエヌ	4.1	4.1	18,163	イチ・ツ・オーリテイリング	26.9	29.2	42,427	滋賀銀行	53	49	24,451
ビックカメラ	26.9	32.6	27,416	近鉄百貨店	21	27	9,126	南都銀行	49	52	19,084
DCMホールディングス	28.6	28	24,024	ニッセンHD	17.9	—	—	百五銀行	55	50	18,900
Monotaro	10.1	21	55,650	パルコ	8.2	6.6	6,408	京都銀行	105	107	80,143
アークランドサービスHD	0.6	2.6	7,904	丸井グループ	60	70.6	99,616	紀陽銀行	21.9	21.7	34,155
J. フロント リテイリング	71.2	72.4	92,382	AKSリアル リテイリング	5	4.8	15,480	三重銀行	39	28	5,796
ドトール・日レスHD	10.3	10.2	19,033	イオン	229.6	238.5	355,365	ほくほくフィナンシャルG	365	370	52,170
マツモトキヨシHLDGS	12.7	11.9	60,095	ユニークグループ・HD	57.8	—	—	広島銀行	160	165	68,970
ブロンコビリー	1.6	3.3	9,810	イズミ	12.7	11.2	47,712	山陰合同銀行	35	34	23,800
スタートトゥデイ	17.7	18	89,550	東武ストア	18	1.7	4,722	中国銀行	37.4	37.8	46,645
トレジャー・ファクトリー	0.6	—	—	平和堂	12.1	11.7	24,078	鳥取銀行	—	34	5,712
物語コーポレーション	1.8	1.9	8,483	フジ	7	6.8	13,219	伊予銀行	58.3	55.8	35,265
ココカラファイン	6.2	6.1	23,088	ヤオコー	6.7	6.6	26,664	百十四銀行	62	60	18,480
三越伊勢丹HD	111.3	113.5	116,905	ゼビオホールディングス	7.9	8	12,488	四国銀行	50	46	10,028
ウエルシアHD	5.3	5.1	33,915	ケーズホールディングス	13	23.8	40,483	阿波銀行	43	44	28,116
クリエイトSDH	2.9	8.9	20,407	アインホールディングス	7.1	7.1	44,588	鹿児島銀行	38	—	—
チムニ	0.9	2	5,376	ヤマダ電機	217.2	170.9	86,817	大分銀行	36	33	11,715
ジョイフル本田	7.4	9.3	23,919	アークランドサカモト	4.6	10.7	11,994	宮崎銀行	42	39	10,530
すかいらーく	17.9	17.7	23,452	ニトリホールディングス	24	25.3	282,348	肥後銀行	47	—	—
ユナイテッド・スーパーマーケット	19.8	19.4	19,050	吉野家ホールディングス	15.5	21.2	30,485	佐賀銀行	44	38	9,310
あさひ	4.5	5.3	6,815	松屋フーズ	3.4	3.6	10,836	十八銀行	41	37	11,396
日本調剤	0.6	1.9	7,581	サガミチェーン	9	9.5	11,913	沖縄銀行	4.5	5.5	16,555
コスモス薬品	2.9	2.9	57,014	王将フードサービス	4	4.3	17,479	琉球銀行	12.7	12.5	14,937
セブン&アイ・HLDGS	233.9	241.4	1,097,404	プレナス	6.6	6.7	12,127	セブン銀行	187	208.7	71,166
薬王堂	0.3	—	—	ミニストップ	5.3	4.9	8,584	みずほフィナンシャルG	7,840.3	8,180.9	1,425,112
クリエイト・レストランズ・ホール	4.7	16.8	17,136	アークス	9.9	10.7	26,215	高知銀行	—	107	11,556
ツルハホールディングス	11.9	13.5	145,125	パローホールディングス	12.8	12.4	35,290	山口フィナンシャルG	54	51	54,468
サンマルクホールディングス	4.6	4.8	13,190	ベルク	3.2	3.1	11,470	長野銀行	—	33	6,468
トリドール	6.8	7.3	16,563	ファーストリテイリング	11.2	9.7	315,347	名古屋銀行	52	48	16,896
クスリのオキ	4.8	5.5	21,450	サンドラッグ	11.8	12.4	98,580	北洋銀行	80.1	82.5	29,535
メディカルシステムネットワーク	2.9	14.9	7,017	ザックスパーホールディング	5.1	7	7,266	愛知銀行	2.4	2.1	10,731
総合メディカル	3.4	3.1	10,307	ペルレーナ	17.1	15.9	9,762	第三銀行	45	39	6,825
カップ・クリエイト	9.9	9.4	11,703	銀行業 (7.7%)				中京銀行	—	27	6,453
ライトオン	—	5.7	6,857	じもとホールディングス	47.1	51.6	7,224	東日本銀行	30	—	—
良品計画	6.9	6.7	128,908	足利ホールディングス	33.8	42.2	16,922	大光銀行	34	28	6,076
アルビス	—	2.3	4,797	東京TYフィナンシャルG	7.5	8.3	23,430	愛媛銀行	37	31	7,967
コナカ	9.1	11	5,423	九州フィナンシャルG	—	86	55,126	トマト銀行	46	85	13,005
コーナン商事	10.6	8.9	17,043	ゆうちょ銀行	—	150.5	184,362	みなと銀行	52	57	9,462
ワタミ	8.6	9	10,440	コンロディ・フィナンシャル	—	393.2	190,977	京業銀行	44	44	18,920
ドンキホーテホールディング	36	37.2	132,432	新生銀行	543	519	79,407	関西アーバン銀行	6	6.7	6,746
西松屋チェーン	12.3	12	17,616	おおぞら銀行	390	372	132,060	栃木銀行	32	33	13,827
ゼンショーホールディングス	28.5	29.4	52,243	三菱UFJフィナンシャルG	4,488.1	4,616.9	2,379,550	北日本銀行	2.5	2.8	7,767
幸楽苑ホールディングス	6.2	5.6	8,635	リソナホールディングス	655.7	673.8	292,429	東和銀行	87	91	8,008

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
千株	千株	千円	
福島銀行	99	102	9,282
大東銀行	55	61	10,492
トモニホールディングス	46.4	45.2	21,470
フィデアホール	40	55.5	8,769
池田泉州HD	47.1	53	24,963
証券・商品先物取引業 (1.0%)			
F P G	16	21.2	19,504
S B Iホールディングス	67.9	68.8	81,321
ジャフコ	8.1	10	29,000
大和証券G本社	519	527	302,656
野村ホールディングス	1,139.2	1,092.9	504,045
岡三証券グループ	49	42	21,504
丸三証券	19.8	19.2	16,185
東洋証券	31	35	6,335
東海東京HD	65.6	64.7	32,285
光世証券	—	68	7,820
水戸証券	24.8	27.5	6,765
いよよし証券	13.8	16.2	13,332
松井証券	29.4	23.5	21,502
マネックスG	70.1	74.4	17,930
カブドットコム証券	54.2	55.8	18,525
極東証券	9.4	9.9	13,295
岩井コスモホールディング	7.2	7.8	7,176
監理證券	5	14.1	7,966
マネースクウェアHD	1.4	7.8	9,703
保険業 (2.4%)			
かんぽ生命保険	—	24.4	55,510
損保ジャパン興亜HD	124.2	126.9	401,004
アニコムホールディングス	2.5	5.2	12,594
MS&AD	178.3	170.3	495,487
SONY F H	54	56.5	83,789
第一生命	358.2	365.3	525,484
東京海上HD	226.7	231.8	903,324
T & Dホールディングス	203.9	207.8	253,931
その他金融業 (1.3%)			
全国保証	15.1	15.2	61,332
クレディセゾン	45.9	43.5	75,255
アクリティブ	1.9	—	—
芙蓉総合リース	6.2	6.7	32,897
興銀リース	11.2	11.1	22,344
東京センチュリーリース	13.3	13.4	48,843
日本証券金融	26.4	24.1	10,700
アイフル	93.3	98.2	30,834
ポケットカード	—	9.4	4,794
リコーリース	5.3	4.9	12,960
イオンフィナンシャルサービス	37.1	37.4	66,833
アコム	113.3	122.6	59,951
ジャックス	33	33	13,068
オリコ	131.8	248.4	49,431
日立キャピタル	11.4	13.9	31,024
アプラスフィナンシャル	21	—	—
オリックス	394.5	408.8	601,140
三菱UFJリース	138.1	141.1	65,047
日本取引所グループ	81.6	166.7	269,053
イー・ギャラリーエン	1.2	3.1	8,063
NECキャピタルリレーション	3.6	3.4	5,589
不動産業 (2.5%)			
いちじ	—	60.9	26,004
日本駐車場開発	73.7	78.1	10,855
ヒューリック	115	120	118,440
野村不動産HLDGS	33.8	37	62,900
三井交通グループHD	—	14.7	5,615
日本商業開発	1	—	—
プレサンスコーポレーション	2.5	2.3	9,729
ユニホールディングス	2.6	4.1	11,496
日本管理センター	2.8	5.5	6,710
オープンハウス	8	8.9	20,203
東急不動産HD	150	139.3	75,500
飯田GH	35.7	52.6	101,518
パーク24	28.8	29	89,465
三井不動産	296	305	633,332
三菱地所	415	431	807,263
平和不動産	13.4	12.2	16,616

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
千株	千株	千円	
東京建物	62.5	62.8	76,239
ダイビル	16.3	15.7	13,784
京阪神ビルディング	16.1	11.8	5,982
住友不動産	133	138	359,559
大京	90	107	18,832
テオーシー	20.9	23	17,733
東京築天地	16	19	9,120
レオパレス21	62.6	67.8	45,493
スターツコーポレーション	7.7	6.9	12,137
フジ住宅	13	12.2	8,308
空港施設	10.9	12.1	6,050
住友不動産販売	4.1	4.6	9,181
ゴールドクレスト	5.6	4.9	7,928
タカラレーベン	27.8	27.1	17,723
サンヨーハウジング名古屋	5.9	5.9	5,186
イオンモール	36	36	52,848
トーセイ	10.5	11.1	8,003
エヌ・ティ・ティ都市開発	36.4	34.4	32,748
サンフロンティア不動産	7.1	8.5	8,321
エフ・ジェー・ネクスト	—	14.9	7,673
日本空港ビルデング	19.4	18.2	72,527
サービス業 (3.8%)			
日本工営	25	23	9,821
ネクスト	16.2	18.6	13,968
日本M&Aセンター	9.7	9.7	58,200
アユーディア・ゴルフ	24.2	16.7	17,785
タケエ	8.1	9.3	7,412
パソナグループ	3.5	7.4	5,705
G C A	6	8.6	6,389
エス・エム・エス	7.5	8.6	20,347
テンポホールディングス	12.1	43.6	70,457
クックパッド	12.6	14.5	14,007
エスクリ	0.9	—	—
学情	1.4	—	—
スタジオアリス	3.8	3.6	7,725
ジミックホールディングス	3.6	4.2	6,039
総合警備保障	19.9	20.7	104,949
カカコム	40.1	44.5	78,275
アイロムグループ	0.8	—	—
ディップ	7.5	7.6	22,625
新日本科学	7.1	—	—
ツクイ	9.1	17	12,138
エムスリー	51.8	54.1	165,275
ツカガ・グローバルHOLD	6.6	6.8	4,583
アウトソーシング	2.3	3.3	11,946
ウェルネット	1.5	6.3	8,328
ディー・エヌ・エー	29.8	28.1	107,342
博報堂DYHLDGS	81.4	83.4	95,826
ぐるなび	7.5	7.5	19,747
エスアールジータカミヤ	3.3	—	—
一休	5.5	—	—
ファンコミュニケーションズ	12.6	15.9	11,829
インフォマート	—	13	13,286
J Pホールディングス	21.1	22.2	6,060
E P Sホールディングス	7.1	7.7	10,387
プレステージ・インター	6.8	6.7	10,452
アミューズ	2.4	4.2	7,543
ドリームインキュベータ	1.4	3.6	7,254
クイック	1.6	—	—
ケネディクス	83.5	82.3	37,858
電通	65.9	68.1	361,611
イオンファンタジー	—	3	7,851
ネクシースグループ	1.5	—	—
みらいホールディングス	15.2	15.3	77,418
アルプス技研	1.7	3.8	8,029
オリエンタルランド	63.7	66.3	408,474
ダスキン	16.9	17.3	31,849
明光ネットワークジャパン	8.3	8.9	8,588
ファルコホールディングス	5.1	4.1	5,362
ラウンドワン	19.1	20.8	14,851
リゾートトラスト	22.9	25.2	51,332
ピー・エム・エル	4.1	8	20,728
りらいあコミュニケーション	12.5	11	10,120

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
千株	千株	千円	
ユー・エス・エス	70.8	73	123,881
東京個別指導学院	1.4	—	—
サイバーエージェント	13.9	16.2	89,748
楽天	275.5	310.8	412,742
セントラルスポーツ	4	3	7,230
フルキャストホールディングス	4.8	8	6,704
テフプロ・ホールディング	7.7	10.3	35,586
ジャパンマテリアル	1.9	3.2	11,056
ベクトル	—	8.4	7,551
キャリアリンク	0.3	—	—
N・フィールド	1.7	—	—
リクルートホールディングス	88.9	124.1	475,923
日本郵政	—	180.8	241,910
リログループ	2.2	2.4	37,032
東洋	0.7	2.2	9,878
イイチ・アイ・エス	10	10	26,040
共立メンテナンス	3.8	4.7	30,315
イチスホールディングス	10.2	11.7	10,834
建設技術研究所	4.8	5.7	5,130
東京デパート	47	98	11,662
よみうりランド	17	18	8,442
東京都競馬	47	45	8,955
常盤興産	44	79	12,245
カナモト	8.7	8.6	20,700
東京ドーム	48	26	25,480
西尾レントオール	5.2	5.1	13,856
トランス・コスモス	8.4	7.6	19,760
乃村工務社	13	13.9	19,293
藤田観光	27	25	8,975
KNT-CTホールディングス	33	37	4,329
日本財財	4	6.2	9,399
トーカイ	3.3	3.1	10,168
セコム	57.3	63.4	481,586
丹青社	12.6	13.6	9,846
メイテック	8.5	7.8	27,378
アサツキ ディー・ケー	11.5	10.7	27,338
応用地質	7.4	7.4	7,666
船井総研ホールディング	8.7	9.9	14,384
ベネッセホールディングス	20.9	20	52,600
イオンディライト	6.2	6.2	18,438
ナック	5.7	—	—
ニチイ学館	13.6	12	9,300
ダイセキ	10.6	12.1	22,288
合 計			
株数・金額	95,120.9	96,137.1006	113,492,368
銘柄数<比率>	1,395銘柄	1,397銘柄	<99.7%>

- (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) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末
買建額	売建額
国内	百万円
TOPIX	208
株	株
円	円

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

区分	当期末
貸付	借入
株	株
2,980,000	—
(1,418,700)	(—)

- (注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
(注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人等のうち、大和証券へ1,418,700株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2016年9月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	113,492,368	96.0
コール・ローン等、その他	4,748,839	4.0
投資信託財産総額	118,241,208	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

2016年9月20日現在

項 目		当 期 末
(A) 資産		118,843,008,139円
コール・ローン等		4,691,441,691
株式(評価額)		113,492,368,988
未収配当金		45,069,856
未収利息		244,714
その他未収収益		4,042,890
差入委託証拠金		609,840,000
(B) 負債		5,050,563,986
未払金		6,817,280
未払解約金		74,688,500
差入委託証拠金代用有価証券		601,800,000
受入担保金		4,367,258,206
(C) 純資産総額(A－B)		113,792,444,153
元本		143,240,630,767
次期繰越損益金		△ 29,448,186,614
(D) 受益権総口数		143,240,630,767口
1万口当り基準価額(C／D)		7,944円

* 期首における元本額は142,153,807,198円、当期中における追加設定元本額は14,010,676,969円、同解約元本額は12,923,853,400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、適格機関投資家専用投信1号1,611,697,194円、トピックス・インデックスファンド5,870,349,708円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A 14,459,562,673円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2 123,973,859円、ダイワ国内重視バランスファンド3 0 V A (一般投資家私募) 155,132,020円、ダイワ国内重視バランスファンド5 0 V A (一般投資家私募) 2,622,187,560円、ダイワ国際分散バランスファンド3 0 V A (一般投資家私募) 118,142,999円、ダイワ国際分散バランスファンド5 0 V A (一般投資家私募) 3,671,223,973円、D－I’s T O P I Xインデックス33,397,291円、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド24,801,250円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 593,766円、i F r e e T O P I Xインデックス14,707,636円、i F r e e 8資産バランス9,416,329円、D Cダイワ日本株式インデックス64,175,618,880円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 2,466,829,698円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 2,424,386,068円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 2,171,081,155円、年金ダイワ日本株式インデックス3,783,254,324円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 26,357,149円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 62,358,348円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 12,485,710円、ダイワ世界分散バランスファンド1 5 V A 448,097円、ダイワ世界分散バランスファンド2 0 V A 440,730円、ダイワ世界分散バランスファンド2 0 V A (国内株式型) 941,908円、ダイワ世界分散バランスファンド2 5 V A 65,202,419円、ダイワ世界分散バランスファンド3 0 V A 369,460,228円、ダイワ世界分散バランスファンド3 0 V A (国内株式型) 200,755,185円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A 1,628,116,331円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 256,425,062円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 15,311,443,452円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 432,461,659円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 742,797,027円、ダイワ・バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家専用) 1,317,289,178円、ダイワ国内バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家専用) 203,482,755円、ダイワ国内バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家専用) 327,434,084円、ダイワ・ノーロードT O P I Xファンド26,401,434円、ダイワ・インデックスセレクトT O P I X 967,581,041円、ダイワライフスタイル2 5 225,777,125円、ダイワライフスタイル5 0 688,315,084円、ダイワライフスタイル7 5 518,580,161円、D C・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド) 16,119,720,217円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は7,944円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は29,448,186,614円です。

■損益の状況

当期 自2015年9月25日 至2016年9月20日

項 目		当 期
(A) 配当等収益		2,521,136,803円
受取配当金		2,462,301,050
受取利息		1,897,406
その他収益金		57,868,435
支払利息	△	930,088
(B) 有価証券売買損益	△	9,193,627,143
売買益		5,582,996,450
売買損	△	14,776,623,593
(C) 先物取引等損益	△	31,477,933
取引益		321,803,097
取引損	△	353,281,030
(D) その他費用	△	4,167
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	△	6,703,972,440
(F) 前期繰越損益金	△	22,339,312,963
(G) 解約差損益金		2,038,156,100
(H) 追加信託差損益金	△	2,443,057,311
(I) 合計(E + F + G + H)	△	29,448,186,614
次期繰越損益金(I)	△	29,448,186,614

(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。

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第17期（決算日 2016年11月30日）

（計算期間 2015年12月1日～2016年11月30日）

日本債券インデックスマザーファンドの第17期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主 要 投 資 対 象	わが国の公社債
運 用 方 法	主としてわが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
株 式 組 入 制 限	純資産総額の30％以下

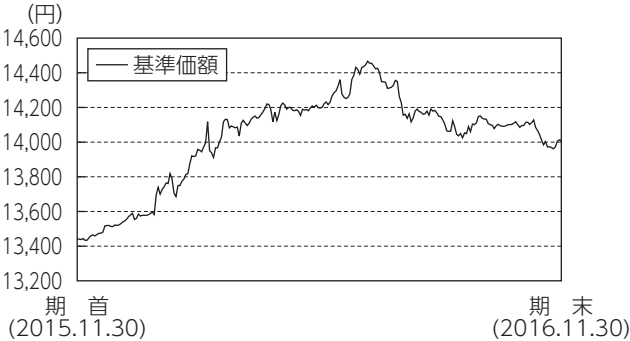
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (D B I) 総合指数		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首)2015年11月30日	13,440	%	503.440	%	98.3	—
12月末	13,522	0.6	506.583	0.6	99.3	—
2016年 1 月末	13,696	1.9	512.896	1.9	98.5	—
2 月末	13,921	3.6	521.658	3.6	98.6	—
3 月末	14,035	4.4	525.949	4.5	99.2	—
4 月末	14,159	5.3	530.628	5.4	99.0	—
5 月末	14,213	5.8	532.551	5.8	98.9	—
6 月末	14,392	7.1	539.272	7.1	99.1	—
7 月末	14,263	6.1	534.760	6.2	99.4	—
8 月末	14,128	5.1	529.357	5.1	99.2	—
9 月末	14,137	5.2	529.782	5.2	99.5	—
10 月末	14,096	4.9	528.193	4.9	99.3	—
(期末)2016年11月30日	14,008	4.2	524.807	4.2	98.5	—

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) ダイワ・ボンド・インデックス (D B I) 総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。
(注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：13,440円 期末：14,008円 騰落率：4.2%

【基準価額の主な変動要因】

債券からの利息収入に加えて、金利水準の低下による債券の値上がり益が発生したことにより、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内債券市況

国内長期金利は、2016年1月下旬に日銀がマイナス金利政策を導入したことを受け、2月にかけて大きく低下しました。その後、市場の追加金融緩和観測が根強かったことや、英国の国民投票でEU (欧州連合) 離脱派が勝利し、金融市場全般にリスク回避の動きが広がったことから、長期金利は一段と低下しました。7月末には、日銀はETF (上場投資信託) の買い入れの増額を主体とする金融緩和の強化を実施した上で、次回会合で経済・物価動向や政策効果について総括的な検証を行なうことを発表しました。しかし、金融緩和の強化が市場の期待を下回る規模であったほか、総括的な検証が日銀の金融緩和姿勢の後退につながる恐れがあるとの警戒感も高まったことから、国内長期金利は8月上旬にかけて急上昇した後、横ばいから上昇基調で推移しました。また11月には、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことで、今後の財政拡大などが意識された米国国債安に連れて、国内長期金利は一段と上昇しました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆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、ファンドの資金流入出や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行ないました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差異は0.0%で、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。金利や信用スプレッドの変動に対する感応度を適切にコントロールしたことから、目立った超過損益は発生しませんでした。

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
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

(2015年12月 1 日から2016年11月30日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	9,697,823	10,014,892 (—)
	地方債証券	120,813	831,101 (—)
	特殊債券	217,572	1,459,235 (—)
	社債券	—	1,217,684 (—)

(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

(2015年12月 1 日から2016年11月30日まで)

当			期		
買 付			売 付		
銘 柄	金 額		銘 柄	金 額	
	千円			千円	
342 10年国債 0.1% 2026/3/20	513,071		353 2年国債 0.1% 2017/6/15	401,609	
368 2年国債 0.1% 2018/9/15	513,021		355 2年国債 0.1% 2017/8/15	361,518	
343 10年国債 0.1% 2026/6/20	511,435		105 5年国債 0.2% 2017/6/20	301,555	
125 5年国債 0.1% 2020/9/20	507,182		338 10年国債 0.4% 2025/3/20	277,905	
127 5年国債 0.1% 2021/3/20	506,821		123 5年国債 0.1% 2020/3/20	272,960	
366 2年国債 0.1% 2018/7/15	502,885		288 10年国債 1.7% 2017/9/20	259,387	
341 10年国債 0.3% 2025/12/20	492,659		104 5年国債 0.2% 2017/3/20	254,763	
128 5年国債 0.1% 2021/6/20	426,368		349 2年国債 0.1% 2017/2/15	250,337	
126 5年国債 0.1% 2020/12/20	395,355		106 5年国債 0.2% 2017/9/20	241,381	
340 10年国債 0.4% 2025/9/20	385,220		335 10年国債 0.5% 2024/9/20	230,826	

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

■ 組入資産明細表

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

区 分	額面金額	評 価 額	組入比率	期 末		
				うち B B 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	2年末満
国債証券	千円 36,119,000	千円 40,657,453	% 78.3	% —	% 52.4	% 18.5
地方債証券	3,650,000	3,811,406	7.3	—	3.4	3.1
特殊債券 (除く金融債券)	3,019,000	3,171,646	6.1	—	3.7	1.2
金融債券	200,000	200,916	0.4	—	—	—
普通社債券	3,200,000	3,308,223	6.4	—	1.6	3.8
合 計	46,188,000	51,149,645	98.5	—	61.2	26.6

(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。

(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
国債証券	107 5年国債	0.2000	190,000	190,908	2017/12/20
	108 5年国債	0.1000	115,000	115,423	2017/12/20
	289 10年国債	1.5000	48,000	48,880	2017/12/20
	360 2年国債	0.1000	130,000	130,503	2018/01/15
	362 2年国債	0.1000	40,000	40,162	2018/03/15
	109 5年国債	0.1000	50,000	50,211	2018/03/20
	110 5年国債	0.3000	80,000	80,545	2018/03/20
	111 5年国債	0.4000	120,000	120,974	2018/03/20
	290 10年国債	1.4000	132,000	134,769	2018/03/20
	291 10年国債	1.3000	109,000	111,145	2018/03/20
	292 10年国債	1.7000	155,000	158,856	2018/03/20
	38 利付国債 20年	2.7000	60,000	62,276	2018/03/20
	39 20年国債	2.6000	90,000	93,297	2018/03/20
	363 2年国債	0.1000	70,000	70,297	2018/04/15
	364 2年国債	0.1000	85,000	85,370	2018/05/15
	365 2年国債	0.1000	95,000	95,416	2018/06/15
	112 5年国債	0.4000	150,000	151,384	2018/06/20
	113 5年国債	0.3000	130,000	130,998	2018/06/20
	293 10年国債	1.8000	238,000	245,351	2018/06/20
	294 10年国債	1.7000	147,000	151,312	2018/06/20
	295 10年国債	1.5000	175,000	179,576	2018/06/20
	366 2年国債	0.1000	440,000	441,993	2018/07/15
	367 2年国債	0.1000	60,000	60,286	2018/08/15
	368 2年国債	0.1000	510,000	512,555	2018/09/15
	114 5年国債	0.3000	140,000	141,239	2018/09/20
	115 5年国債	0.2000	145,000	146,007	2018/09/20
	296 10年国債	1.5000	25,000	25,758	2018/09/20
	40 20年国債	2.3000	57,000	59,557	2018/09/20
	116 5年国債	0.2000	498,000	501,839	2018/12/20
	297 10年国債	1.4000	70,000	72,259	2018/12/20
	298 10年国債	1.3000	125,000	128,778	2018/12/20
	117 5年国債	0.2000	400,000	403,408	2019/03/20
	299 10年国債	1.3000	250,000	258,410	2019/03/20
	300 10年国債	1.5000	286,000	296,939	2019/03/20
	41 20年国債	1.5000	136,000	141,234	2019/03/20
	42 20年国債	2.6000	87,000	92,554	2019/03/20
	118 5年国債	0.2000	140,000	141,306	2019/06/20
	119 5年国債	0.1000	330,000	332,237	2019/06/20
	301 10年国債	1.5000	120,000	125,095	2019/06/20
	120 5年国債	0.2000	180,000	181,796	2019/09/20
	121 5年国債	0.1000	50,000	50,358	2019/09/20

日本債券インデックスマザーファンド

当		期		末	
区 分	銘 柄	年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	303 10年国債	1.4000	10,000	10,435	2019/09/20
	304 10年国債	1.3000	60,000	62,446	2019/09/20
	43 20年国債	2.9000	100,000	108,591	2019/09/20
	122 5年国債	0.1000	340,000	342,550	2019/12/20
	305 10年国債	1.3000	470,000	490,722	2019/12/20
	123 5年国債	0.1000	300,000	302,331	2020/03/20
	306 10年国債	1.4000	255,000	267,956	2020/03/20
	307 10年国債	1.3000	240,000	251,400	2020/03/20
	44 20年国債	2.5000	85,000	92,399	2020/03/20
	45 20年国債	2.4000	78,000	84,531	2020/03/20
	124 5年国債	0.1000	340,000	342,723	2020/06/20
	308 10年国債	1.3000	150,000	157,617	2020/06/20
	309 10年国債	1.1000	90,000	93,928	2020/06/20
	46 20年国債	2.2000	73,000	79,043	2020/06/22
	125 5年国債	0.1000	400,000	403,356	2020/09/20
	310 10年国債	1.0000	30,000	31,276	2020/09/20
	311 10年国債	0.8000	30,000	31,047	2020/09/20
	47 20年国債	2.2000	89,000	96,869	2020/09/21
	126 5年国債	0.1000	360,000	363,146	2020/12/20
	312 10年国債	1.2000	395,000	416,045	2020/12/20
	48 20年国債	2.5000	54,000	59,736	2020/12/21
	127 5年国債	0.1000	500,000	504,530	2021/03/20
	313 10年国債	1.3000	180,000	190,953	2021/03/20
	314 10年国債	1.1000	260,000	273,577	2021/03/20
	49 20年国債	2.1000	64,000	70,097	2021/03/22
	50 20年国債	1.9000	107,000	116,269	2021/03/22
	128 5年国債	0.1000	420,000	423,931	2021/06/20
	315 10年国債	1.2000	221,000	234,125	2021/06/20
	316 10年国債	1.1000	55,000	58,015	2021/06/20
	51 20年国債	2.0000	82,000	89,831	2021/06/21
	129 5年国債	0.1000	330,000	333,260	2021/09/20
	317 10年国債	1.1000	214,000	226,330	2021/09/20
	318 10年国債	1.0000	200,000	210,560	2021/09/20
	52 20年国債	2.1000	52,000	57,506	2021/09/21
	319 10年国債	1.1000	100,000	106,063	2021/12/20
	320 10年国債	1.0000	120,000	126,666	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	66,000	73,368	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	65,000	72,586	2021/12/20
	321 10年国債	1.0000	175,000	185,150	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	50,000	52,634	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	140,000	155,535	2022/03/21
	325 10年国債	0.8000	170,000	178,768	2022/09/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	49,899	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,906	2022/12/20
	328 10年国債	0.6000	100,000	104,302	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	106,901	2023/03/20
	329 10年国債	0.8000	160,000	169,211	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	100,469	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	145,991	2023/06/20
	330 10年国債	0.8000	262,000	277,573	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	100,000	104,577	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	102,078	2023/09/20
	332 10年国債	0.6000	220,000	230,278	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	85,000	96,793	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	135,000	152,775	2023/12/20
	333 10年国債	0.6000	265,000	277,611	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	62,830	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	139,719	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	127,271	2024/03/20
	334 10年国債	0.6000	320,000	335,504	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	98,331	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	146,197	2024/06/20

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	
	335 10年国債	0.5000	470,000	489,664	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	175,000	204,221	2024/09/20
	336 10年国債	0.5000	175,000	182,483	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	145,000	148,859	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	139,654	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	85,545	2024/12/20
	338 10年国債	0.4000	200,000	207,066	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	94,092	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	59,136	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	151,884	2025/03/20
	339 10年国債	0.4000	390,000	403,848	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	71,028	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	58,648	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	62,620	2025/06/20
	340 10年国債	0.4000	510,000	528,416	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	76,000	89,493	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	103,213	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	460,000	472,700	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	110,773	2025/12/20
	84 20年国債	2.0000	100,000	118,205	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	503,000	507,672	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	69,354	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	97,148	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	66,278	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	500,000	504,530	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	121,902	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	94,338	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	360,000	362,991	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	120,000	145,657	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	60,000	73,416	2026/09/20
	92 20年国債	2.1000	180,000	217,440	2026/12/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	120,220	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	65,000	78,809	2027/03/20
	95 20年国債	2.3000	3,000	3,712	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	100,000	121,637	2027/06/20
	97 20年国債	2.2000	81,000	99,760	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	90,000	109,877	2027/09/20
	99 20年国債	2.1000	170,000	208,180	2027/12/20
	100 20年国債	2.2000	142,000	176,094	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	35,000	44,188	2028/03/20
	102 20年国債	2.4000	80,000	101,352	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	70,000	87,881	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	40,000	49,301	2028/06/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	155,843	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	67,000	83,652	2028/09/20
	107 20年国債	2.1000	107,000	132,794	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	127,000	154,584	2028/12/20
	109 20年国債	1.9000	90,000	109,809	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	90,000	111,999	2029/03/20
	111 20年国債	2.2000	100,000	126,102	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	125,000	156,077	2029/06/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	21,432	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	125,000	156,496	2029/09/20
	114 20年国債	2.1000	130,000	163,174	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	110,000	139,485	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	31,120	2030/02/20
	116 20年国債	2.2000	89,000	113,151	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	140,000	176,162	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	38,639	2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	15,000	18,721	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	113,601	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	146,000	174,456	2030/06/20

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	
	121 20年国債	1.9000	135,000	167,053	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	110,000	134,629	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	49,611	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	140,000	177,562	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	93,000	116,672	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	85,000	109,234	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	70,000	88,001	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	90,000	111,886	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	36,048	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	119,000	148,226	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	95,000	116,983	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	110,000	135,688	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	100,000	121,912	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	31,765	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	72,000	87,906	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	175,000	216,221	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	50,000	61,873	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	112,481	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	80,000	96,622	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	72,323	2032/05/20
	137 20年国債	1.7000	85,000	104,068	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	87,000	103,897	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	55,000	66,510	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	230,000	281,975	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	33,556	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	50,786	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	140,000	171,719	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	90,000	111,783	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	50,989	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	180,000	218,219	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	55,000	65,816	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	49,216	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	215,000	264,327	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	77,770	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	204,000	250,881	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	96,147	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	95,000	115,311	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	110,677	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	207,000	247,843	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	100,000	136,903	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	208,000	248,986	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	60,000	82,235	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	225,000	265,698	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	80,000	108,486	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	190,000	217,785	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	107,284	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	215,000	246,211	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	76,492	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	225,000	261,771	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	60,000	82,827	2035/09/20
	154 20年国債	1.2000	220,000	251,873	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	80,749	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	228,000	252,660	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	70,000	96,940	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	243,000	241,916	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	60,000	83,145	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	218,000	208,394	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	127,797	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	115,000	116,150	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	60,000	81,159	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	110,000	151,155	2037/03/20
	27 30年国債	2.5000	100,000	140,056	2037/09/20

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	
	28 30年国債	2.5000	117,000	164,569	2038/03/20
	29 30年国債	2.4000	135,000	188,007	2038/09/20
	30 30年国債	2.3000	137,000	188,929	2039/03/20
	31 30年国債	2.2000	130,000	177,409	2039/09/20
	32 30年国債	2.3000	155,000	215,916	2040/03/20
	33 30年国債	2.0000	185,000	246,379	2040/09/20
	34 30年国債	2.2000	158,000	218,556	2041/03/20
	35 30年国債	2.0000	195,000	261,847	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	181,000	244,159	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	201,000	267,137	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	119,000	155,857	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	116,000	154,969	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	103,000	135,283	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	113,000	145,829	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	111,000	143,508	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	124,000	160,611	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	120,000	155,715	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	125,000	155,940	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	152,000	189,677	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	147,000	187,629	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	162,000	198,454	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	139,000	170,515	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	150,000	159,864	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	145,000	134,758	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	111,000	109,019	2046/09/20
	1 40年国債	2.4000	85,000	129,228	2048/03/20
	2 40年国債	2.2000	116,000	171,069	2049/03/20
	3 40年国債	2.2000	74,000	110,064	2050/03/20
	4 40年国債	2.2000	82,000	122,809	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	180,440	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	149,014	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	164,316	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	21,000	26,478	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	102,000	93,578	2056/03/20
種別	銘柄数	-----	261銘柄	-----	-----
小計	金額	-----	36,119,000	40,657,453	-----
地方債証券	61 共同発行地方	1.5500	100,000	102,206	2018/04/25
	660 東京都公債	1.5800	100,000	102,499	2018/06/20
	25-3 京都市5年	0.3120	100,000	100,637	2018/09/27
	20-6 愛知県公債	1.7100	100,000	103,503	2018/11/28
	665 東京都公債	1.4300	100,000	103,046	2018/12/20
	21-2 千葉県公債	1.5700	100,000	103,996	2019/05/24
	163 神奈川県公債	1.4000	100,000	103,678	2019/06/20
	21-3 埼玉県公債	1.6400	100,000	104,317	2019/06/25
	76 共同発行地方	1.4000	50,000	51,904	2019/07/25
	21-6 千葉県公債	1.4100	100,000	104,068	2019/09/25
	81 共同発行地方	1.3200	100,000	104,129	2019/12/25
	21-3 広島市公債	1.3400	100,000	104,190	2019/12/25
	21-5 京都市公債	1.4500	100,000	104,757	2020/02/25
	471 名古屋市債	1.2700	100,000	104,524	2020/06/19
	688 東京都公債	0.9400	100,000	103,614	2020/09/18
	90 共同発行地方	1.1200	100,000	104,296	2020/09/25
	22-1 岡山県公債	1.0500	100,000	104,191	2020/11/30
	22-5 京都府公債	1.2600	100,000	105,099	2020/12/21
	699 東京都公債	1.0200	100,000	104,851	2021/09/17
	23-2 島根県公債	1.0300	100,000	105,015	2021/11/25
	108 共同発行地方	1.0100	100,000	105,222	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	105,118	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	104,441	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	104,877	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	104,559	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	104,312	2022/09/20

日本債券インデックスマザーファンド

当		期		末	
区 分	銘柄	年利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	24－5 京都府公債	0.8200	100,000	104,572	2022/09/20
	24－10 神戸市公債	0.7960	100,000	104,491	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	104,149	2022/12/22
	24－3 横浜市公債	0.7290	100,000	104,210	2022/12/22
	24－16 愛知県公債	0.7570	100,000	104,453	2023/01/31
	24－4 福井県公債	0.4600	100,000	102,688	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	105,182	2023/09/25
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	104,208	2024/02/23
	26－10 静岡県公債	0.5150	100,000	103,324	2024/11/25
	26－17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,856	2025/02/26
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	118,209	2033/12/09
種別	銘柄数				
小計	金 額				
	37銘柄		3,650,000	3,811,406	
特殊債券 (除金融債)	32 道路機構	1.6100	100,000	102,046	2018/03/20
	64 政保道路機構	1.6000	219,000	225,179	2018/08/29
	5 中日本高速道路	1.8600	100,000	103,255	2018/09/20
	66 政保道路機構	1.5000	100,000	102,784	2018/09/28
	2 政保地方公営機	1.6000	100,000	103,195	2018/11/16
	24 政保中日本道	1.3000	100,000	102,855	2019/01/22
	61 道路機構	1.2400	100,000	104,258	2020/06/19
	13 地方公共団体	1.2780	100,000	104,458	2020/06/26
	110 政保道路機構	1.3000	100,000	104,716	2020/06/30
	3 公営企業15年	2.2000	100,000	109,851	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	104,934	2021/10/28
	81 道路機構	1.0300	100,000	105,004	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	105,265	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	105,172	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	104,701	2022/07/29
	39 政保地方公共団	0.8010	100,000	104,523	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	104,728	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	104,631	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	105,046	2023/02/24
	19 政保政策投資C	0.6680	100,000	104,165	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	104,163	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	104,839	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	103,857	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	105,164	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	103,259	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	102,183	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,803	2025/04/28
	F 143 地方公共団体	1.3510	100,000	112,183	2027/08/25
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	122,416	2029/07/31
種別	銘柄数				
小計	金 額				
	29銘柄		3,019,000	3,171,646	
金融債券	い752 利付商工債	0.3000	100,000	100,343	2018/01/26
	い757 利付農林債	0.3500	100,000	100,573	2018/06/27
種別	銘柄数				
小計	金 額				
	2銘柄		200,000	200,916	
普通社債券	21 NTTデータ	1.6000	100,000	102,006	2018/03/20
	15 NTTドコモ	1.9600	100,000	102,920	2018/06/20
	1 明治安田2013基	0.8200	100,000	100,986	2018/08/08
	9 ジャパンリアルエステイト	0.4970	100,000	100,488	2018/08/30
	472 関西電力	1.7900	100,000	103,426	2018/11/22
	18 西日本旅客鉄	1.7000	100,000	103,287	2018/12/11
	4 リソな銀行劣後	2.7660	100,000	106,877	2019/06/20
	46 NTTファイナンス	0.2500	100,000	100,284	2019/06/20
	14 武田薬品	0.5400	100,000	101,152	2019/07/19
	20 三井住友B K劣	2.2100	100,000	105,728	2019/07/24
	164 オリックス	1.1460	100,000	102,682	2019/08/07
	24 太平洋セメント	0.3900	100,000	99,964	2019/09/11
	423 九州電力	0.9590	100,000	102,472	2019/09/25
	62 東日本旅客鉄道	1.4240	100,000	103,732	2019/09/27

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	
	8 ドイツ銀行AGロンドン	0.4700	100,000	95,269	2019/11/14
	29 東日本高速道	0.1800	100,000	100,451	2020/03/19
	260 北陸電力	2.3300	100,000	107,805	2020/05/25
	9 A U S T ・ N Z 銀行	0.3430	100,000	100,259	2020/07/24
	20 東京三菱銀行	2.5700	100,000	109,284	2020/07/27
	15 トヨタファイナンス	1.8000	100,000	106,240	2020/08/21
	17 シティグループ・インク	2.0400	100,000	105,966	2020/09/16
	72 東日本旅客鉄道	1.2800	100,000	104,577	2020/12/22
	2 イオンF S	0.5720	100,000	100,743	2021/03/18
	9 三菱UF J 信託B K劣	1.6800	100,000	106,667	2021/04/28
	11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,819	2022/06/20
	11 三菱UF J 信託B K	1.3600	100,000	106,322	2022/06/27
	372 中国電力	1.2040	100,000	105,980	2022/08/25
	4 J Xホールディングス	1.1450	100,000	105,418	2022/12/14
	30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	103,212	2022/12/14
	175 オリックス	1.0640	100,000	104,624	2023/11/24
	21 西日本高速道	0.7540	100,000	104,457	2023/12/20
	1 三菱UF J F G 劣後	0.9400	100,000	103,114	2024/06/26
種別	銘柄数				
小計	金 額				
	32銘柄		3,200,000	3,308,223	
合計	銘柄数				
	金 額				
	361銘柄		46,188,000	51,149,645	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	51,149,645	98.4
コール・ローン等、その他	854,412	1.6
投資信託財産総額	52,004,058	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

2016年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	52,004,058,045円
コール・ローン等	281,934,187
公社債(評価額)	51,149,645,931
未収入金	411,031,640
未収利息	157,572,707
前払費用	3,873,580
(B) 負債	98,362,425
未払金	91,609,550
未払解約金	6,752,875
(C) 純資産総額(A－B)	51,905,695,620
元本	37,053,043,176
次期繰越損益金	14,852,652,444
(D) 受益権総口数	37,053,043,176口
1万口当り基準価額(C／D)	14,008円

* 期首における元本額は40,077,387,149円、当期中における追加設定元本額は4,724,277,547円、同解約元本額は7,748,621,520円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）216,435,072円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）1,435,119,843円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）154,601,241円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）2,029,554,751円、D－I's 日本債券インデックス765,717円、DCダイワ日本債券インデックス4,520,031,855円、ダイワ・バランスファンド35VA15,037,977,112円、ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）2,380,007,134円、ダイワ国内バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）316,684,776円、ダイワ国内バランスファンド30VA（適格機関投資家専用）432,222,563円、ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド31,913,378円、ダイワファンドラップ 日本債券インデックス2,148,394,984円、ダイワ・インデックスセレクト 日本債券881,186,341円、ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス6,545,146,286円、ダイワライフスタイル25 420,509,022円、ダイワライフスタイル50 398,353,270円、ダイワライフスタイル75 104,139,831円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,008円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月1日 至2016年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	582,783,197円
受取利息	582,857,295
支払利息	△ 74,098
(B) 有価証券売買損益	1,664,523,752
売買益	1,882,673,450
売買損	△ 218,149,698
(C) その他費用	△ 578
(D) 当期損益金(A + B + C)	2,247,306,371
(E) 前期繰越損益金	13,787,531,066
(F) 解約差損益金	△ 3,093,308,167
(G) 追加信託差損益金	1,911,123,174
(H) 合計(D + E + F + G)	14,852,652,444
次期繰越損益金(H)	14,852,652,444

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第17期（決算日 2016年11月30日）

（計算期間 2015年12月1日～2016年11月30日）

外国株式インデックスマザーファンドの第17期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針	投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主 要 投 資 対 象	外国の株式（預託証券を含みます。）
運 用 方 法	①主として外国の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
株 式 組 入 制 限	無制限

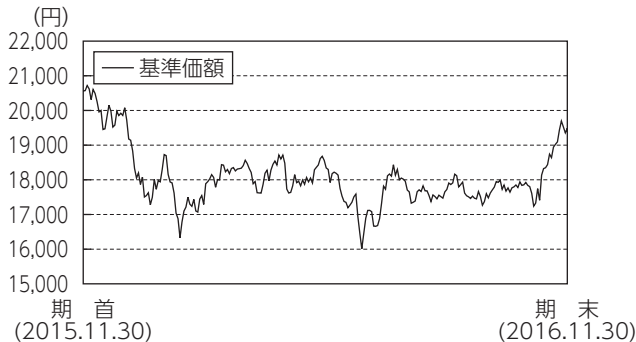
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ 指数 (円ベース)		株式組入 比 率	株式先物 比 率	投資信託 組入比率
	円	騰落率 %	ベンチマーク	騰落率 %			
(期首)2015年11月30日	20,561	—	14,973	—	96.2	1.3	2.4
12月末	20,079	△ 2.3	14,587	△ 2.6	96.1	1.3	2.5
2016年1月末	18,297	△11.0	13,287	△11.3	95.8	1.4	2.6
2月末	17,545	△14.7	12,706	△15.1	95.8	1.4	2.6
3月末	18,563	△ 9.7	13,424	△10.3	95.9	1.4	2.7
4月末	18,479	△10.1	13,317	△11.1	96.0	1.4	2.6
5月末	18,679	△ 9.2	13,403	△10.5	95.6	1.6	2.6
6月末	16,892	△17.8	12,105	△19.2	95.7	1.4	2.9
7月末	17,959	△12.9	12,852	△14.2	95.9	1.3	2.8
8月末	17,906	△12.7	12,792	△14.6	95.3	1.9	2.7
9月末	17,479	△15.0	12,474	△16.7	95.8	1.4	2.7
10月末	17,838	△13.2	12,701	△15.2	95.9	1.3	2.6
(期末)2016年11月30日	19,489	△ 5.2	13,848	△ 7.5	96.0	1.4	2.5

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIコクサイ指数 (円ベース) は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数 (米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数 (米ドルベース) は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

(注4) 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：20,561円 期末：19,489円 騰落率：△5.2%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク (MSCIコクサイ指数 (円ベース)) の動きをほぼ反映して、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は、2016年1月に中国株式市場におけるサーキットブレーカー制度 (現物株の取引を一時停止する制度) の発動による混乱、サウジアラビアとイランの国交断絶などによる地政学リスクの高まりなどを背景に大幅に下落しましたが、2月中旬以降は、産油国の生産量維持に関する合意による原油価格の反発や、米国経済指標の改善などを受けて反発しました。3月以降は、ECB (欧州中央銀行) による追加金融緩和の発表やFOMC (米国連邦公開市場委員会) での利上げ見送りなどが好感され堅調に推移しましたが、6月下旬の英国の国民投票でEU (欧州連合) 離脱派が多数となると欧州情勢への懸念が高まり、世界的なリスク回避の動きの中で一時急落しました。その後は、英国および各国の中央銀行が政策協調を表明したことが好感されて反発し、米国企業の良好な決算内容などを受けて上昇基調となりましたが、米国の利上げ観測に影響されて一進一退の展開が続き、期を通じてはやや上昇して期末を迎えました。

○為替相場

為替相場は、2016年の年明け以降、リスク回避傾向が強まり円高で推移しました。3月には、原油価格が底打ちの様相となってオーストラリア・ドルやカナダ・ドルなどの資源国通貨が買い戻されました。4月以降は、日銀の主要な金融政策において追加緩和が見送られたことから、再び円高が進行しました。その後は、米国の早期利上げ観測の後退や英国の国民投票の結果を受けたリスク回避姿勢の動きから、さらに円高傾向での推移となりました。7月に入るといったんは円安となりましたが、日銀の金融政策決定会合で政策金利が据え置かれたことが市場の失望を誘い、再び円高が進行しました。10月には、原油価格が上昇したことや欧州の一部の銀行に対する経営不安が和らいだことなどをを受けて円安になりました。11月には、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことや金利が上昇し、大きく円安が進みました。

◆前期における「今後の運用方針」

今後の運用にあたりましても、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

◆ポートフォリオについて

外国株式を中心に、S・P500先物取引も一部利用し、株式組入比率 (リート、株式先物を含む。) につきましては、期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は△7.5%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△5.2%となりました。

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

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

《今後の運用方針》

今後の運用にあたりましても、引き続き、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目		当 期	
売買委託手数料		1円	
(株式)		(1)	
(先物)		(0)	
(投資信託証券)		(0)	
有価証券取引税		1	
(株式)		(1)	
(投資信託証券)		(0)	
その他費用		11	
(保管費用)		(11)	
(その他)		(0)	
合 計		13	

(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

(2015年12月 1 日から2016年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 (△ 6,789.3 562.1)	千アメリカ・ドル 36,898 (△ 5,801)	百株 2,127.84	千アメリカ・ドル 8,628
	カナダ	百株 (1,151.7 98.1)	千カナダ・ドル 3,778 (△ 96)	百株 279.5	千カナダ・ドル 262
	オーストラリア	百株 (3,136 5.2)	千オーストラリア・ドル 2,839 (△ 190)	百株 265.5	千オーストラリア・ドル 165
	香港	百株 (3,343 182.29)	千香港ドル 5,446 ()	百株 70	千香港ドル 639
	シンガポール	百株 (1,338 -)	千シンガポール・ドル 269 (△ 15)	百株 2,301.81	千シンガポール・ドル 73
	ニュージーランド	百株 (313 -)	千ニュージーランド・ドル 112 ()	百株 -	千ニュージーランド・ドル -
	イギリス	百株 (△ 8,747 17,827.63)	千イギリス・ポンド 4,235 (△ 1,486)	百株 438.74	千イギリス・ポンド 306
	イスラエル	百株 (27 -)	千イスラエル・シェケル 550 ()	百株 206	千イスラエル・シェケル 3,305
	スイス	百株 (311.63 -)	千スイス・フラン 2,111 (△ 244)	百株 187.5	千スイス・フラン 504
	デンマーク	百株 (136 27)	千デンマーク・クローネ 5,106 ()	百株 19	千デンマーク・クローネ 704
	ノルウェー	百株 (222 -)	千ノルウェー・クローネ 3,291 (△ 47)	百株 -	千ノルウェー・クローネ -

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	スウェーデン	百株 (392.5 -)	千スウェーデン・クローネ 4,855 (△ 120)	百株 -	千スウェーデン・クローネ -
	ユーロ (アイルランド)	百株 (42.5 -)	千ユーロ 350 ()	百株 -	千ユーロ -
	ユーロ (オランダ)	百株 (454 15.3)	千ユーロ 886 (△ 122)	百株 27	千ユーロ 49
	ユーロ (ベルギー)	百株 (△ 32 23)	千ユーロ 249 (△ 7)	百株 14	千ユーロ 107
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 (224 -)	千ユーロ 112 (△ 21)	百株 -	千ユーロ -
	ユーロ (フランス)	百株 (562 35.51)	千ユーロ 2,171 (△ 69)	百株 661	千ユーロ 347
	ユーロ (ドイツ)	百株 (540.5 46.5)	千ユーロ 2,206 (△ 47)	百株 64.5	千ユーロ 232
	ユーロ (スペイン)	百株 (1,638.5 869.43)	千ユーロ 810 (△ 21)	百株 41	千ユーロ 57
	ユーロ (イタリア)	百株 (△ 2,503 78.16)	千ユーロ 536 (△ 45)	百株 942.65	千ユーロ 183
	ユーロ (フィンランド)	百株 (621.5 -)	千ユーロ 473 ()	百株 5	千ユーロ 19
	ユーロ (オーストリア)	百株 (11 -)	千ユーロ 28 (△ 2)	百株 -	千ユーロ -
	ユーロ (その他)	百株 (21 47)	千ユーロ 30 (156)	百株 -	千ユーロ -
国	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 (6,650 912.58)	千ユーロ 7,856 (△ 181)	百株 1,755.15	千ユーロ 998

(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

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 34.48 (4.36)	千アメリカ・ドル 1,885 (-)	千口 2.14 (-)	千アメリカ・ドル 26 (-)
	カナダ	千口 7.8 (-)	千カナダ・ドル 188 (-)	千口 (-)	千カナダ・ドル (-)
	オーストラリア	千口 17 (-)	千オーストラリア・ドル 105 (-)	千口 (-)	千オーストラリア・ドル (-)
	香港	千口 2.5 (-)	千香港ドル 131 (-)	千口 (-)	千香港ドル (-)
	シンガポール	千口 53 (-)	千シンガポール・ドル 86 (△ 0)	千口 (-)	千シンガポール・ドル (-)
	イギリス	千口 5.5 (-)	千イギリス・ポンド 34 (-)	千口 (-)	千イギリス・ポンド (-)
	ユーロ (フランス)	千口 1.46 (-)	千ユーロ 115 (△ 0)	千口 (-)	千ユーロ (-)

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 売付()内は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

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

当 期					期 付				
買		付			売		付		
銘柄	柄	株 数	金 額	平均単価	銘柄	柄	株 数	金 額	平均単価
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR (イスラエル)		千株 20.9	千円 100,444	円 4,805	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD (イスラエル)		千株 20.6	千円 96,915	円 4,704
FACEBOOK INC-A (アメリカ)		7.55	93,584	12,395	APPLE INC (アメリカ)		3.9	49,297	12,640
APPLE INC (アメリカ)		6.7	74,483	11,116	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP (アメリカ)		5.2	34,817	6,695
NXP SEMICONDUCTORS NV (オランダ)		6.8	70,097	10,308	ORACLE CORP (アメリカ)		6.6	29,597	4,484
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)		7.25	66,627	9,190	YUM CHINA HOLDINGS INC (アメリカ)		9.4	28,191	2,999
AMAZON.COM INC (アメリカ)		0.81	60,955	75,254	ALCATEL-LUCENT SA (フランス)		60.2	27,530	457
MICROSOFT CORP (アメリカ)		9.95	58,206	5,849	NESTLE SA-REG (スイス)		3	24,208	8,069
SYNCHRONY FINANCIAL (アメリカ)		15.8	57,846	3,661	AMERICAN EXPRESS CO (アメリカ)		2.9	21,748	7,499
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)		4.7	57,030	12,134	GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)		5.5	19,433	3,533
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)		0.61	49,426	81,026	MCDONALD'S CORP (アメリカ)		1.4	19,131	13,665

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	株式先物取引	百万円 5,402	百万円 5,281	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。

外国株式インデックスマザーファンド

■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 千アメリカ・ドル		邦貨換算金額 千円
(アメリカ)	百株	百株			
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	—	27	180	20,303	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	15	21	280	31,535	情報技術
JARDEN CORP	40	—	—	—	その他
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	13	14.5	153	17,252	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	38	196	662	74,476	金融
ABBOTT LABORATORIES	317	341	1,320	148,472	ヘルスケア
ARCONIC INC	273	103.33	203	22,849	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	33	37.5	314	35,361	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	87	101	627	70,567	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	66	72	492	55,388	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC	60.29	71.79	566	63,677	情報技術
QORVO INC	32	32	173	19,526	情報技術
AFLAC INC	91	97	691	77,728	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	29	27.5	200	22,531	一般消費財・サービス
ADOBE SYSTEMS INC	107	114.5	1,201	135,092	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	50	50	137	15,418	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	25	25	145	16,390	一般消費財・サービス
PEOPLES UNITED FINANCIAL	68	68	125	14,134	金融
GARMIN LTD	26	26	135	15,196	一般消費財・サービス
AETNA INC	74.79	80.79	1,066	119,915	ヘルスケア
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	43	47.5	681	76,612	素材
ALTERA CORP	65	—	—	—	その他
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	158	166	1,881	211,511	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	37.51	37.51	189	21,337	情報技術
WR BERKLEY CORP	21	21	130	14,684	金融
AUTOZONE INC	6.7	6.7	529	59,521	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	47.21	55.71	499	56,159	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	—	209	791	88,955	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	24	26.5	203	22,843	公益事業
CELANESE CORP-SERIES A	33	33	254	28,625	素材
DR HORTON INC	71.66	79.66	229	25,827	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	21	21	99	11,145	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	30	55	332	37,389	ヘルスケア
AUTODESK INC	48	45.5	342	38,496	情報技術
MOODY'S CORP	39	40.5	409	46,026	金融
DEVON ENERGY CORP	82	109	459	51,661	エネルギー
ALBEMARLE CORP	24	26	223	25,122	素材
ATMOS ENERGY CORP	—	23	170	19,172	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	25	50	186	20,938	公益事業
CITIGROUP INC	643.23	661.23	3,671	412,710	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	101	106	1,028	115,637	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	105	115	704	79,211	公益事業
NETSUITE INC	8	—	—	—	その他
ALLEGHANY CORP	3.5	3.5	199	22,384	金融
DUN & BRADSTREET CORP	7.5	9	110	12,455	資本財・サービス
DOMINO'S PIZZA INC	—	11	187	21,130	一般消費財・サービス
HESS CORP	57	65	318	35,842	エネルギー
DAVITA INC	36	38	241	27,195	ヘルスケア
DANAHER CORP	131	142.5	1,127	126,765	ヘルスケア
FORTIVE CORP	—	72	398	44,744	資本財・サービス
AVNET INC	28	28	129	14,508	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	23.7	135	740	83,229	金融

銘柄	期 首	期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	38	40	123	13,895	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	—	40.28	104	11,710	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	134	134	573	64,429	生活必需品
BUNGE LTD	31	31	208	23,387	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	88.25	82.25	552	62,155	情報技術
APPLE INC	1,211	1,239	13,809	1,552,508	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	94	94	635	71,457	金融
BOEING CO/THE	139	135	2,047	230,139	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	32.15	34.65	267	30,037	金融
SPECTRA ENERGY CORP	140.96	159.96	657	73,944	エネルギー
BECTON DICKINSON AND CO	44.37	48.87	844	94,897	ヘルスケア
CDK GLOBAL INC	29	29	170	19,120	情報技術
NISOURCE INC	—	73	163	18,358	公益事業
COLUMBIA PIPELINE GROUP	67	—	—	—	その他
CH. ROBINSON WORLDWIDE INC	31	33.5	251	28,237	資本財・サービス
CR BARD INC	16	16.8	362	40,772	ヘルスケア
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	240.71	250.71	1,179	132,609	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	871.54	936.04	4,770	536,250	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	248	275.5	4,344	488,361	金融
ANSYS INC	19	21	198	22,316	情報技術
H&R BLOCK INC	51	51	114	12,831	一般消費財・サービス
BB&T CORP	168	190	838	94,303	金融
BROADCOM CORP-CL A	116.5	—	—	—	その他
BAKER HUGHES INC	92.23	95.73	578	65,088	エネルギー
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	356	387	2,181	245,202	ヘルスケア
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	13	13	104	11,734	生活必需品
JPMORGAN CHASE & CO	781.2	826.7	6,524	733,463	金融
LEGG MASON INC	21.5	—	—	—	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	56	56	410	46,196	金融
CIGNA CORP	55.5	59	815	91,731	ヘルスケア
LKQ CORP	68	68	224	25,234	一般消費財・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	10	10	131	14,729	金融
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	221.42	258.42	94	10,661	電気通信サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	25	50	234	26,379	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	—	69	183	20,625	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	39.6	39.6	443	49,887	金融
DOLLAR GENERAL CORP	65	65	509	57,223	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	30	38	316	35,636	情報技術
CATERPILLAR INC	121	134	1,260	141,664	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	60	64	267	30,103	公益事業
MOSAIC CO/THE	68	75.5	204	22,967	素材
DELTA AIR LINES INC	44	44	213	24,034	資本財・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	44	43.5	315	35,459	生活必需品
CORNING INC	266	247	596	67,114	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,083	1,159	3,457	388,669	情報技術
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	192	200	1,424	160,086	素材
IONIS PHARMACEUTICALS INC	26	—	—	—	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	317	333	1,351	151,989	金融
WABCO HOLDINGS INC	11	12.5	123	13,829	資本財・サービス
DOW CHEMICAL CO/THE	239	258	1,392	156,594	素材
MSCI INC	—	22	177	19,941	金融
COTY INC-CL A	—	111.39	217	24,481	生活必需品

銘柄	期 首	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千アメリカ・ドル		邦貨換算金額 千円
BROADCOM LTD	56	90.62	1,589	178,739	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	9	10.5	132	14,940	ヘルスケア
ENSCO PLC-CL A	49	—	—	—	エネルギー
DICK'S SPORTING GOODS INC	20	20	120	13,530	一般消費財・サービス
ACUITY BRANDS INC	9	10	252	28,347	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	15	—	—	—	ヘルスケア
ARAMARK	48	53.5	187	21,086	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	—	49	129	14,603	素材
DTE ENERGY COMPANY	38	42	402	45,233	公益事業
CENTENE CORP	22	40	230	25,901	ヘルスケア
CITIZENS FINANCIAL GROUP	90	122	395	44,423	金融
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	38	43	96	10,871	ヘルスケア
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	40.5	207	23,334	金融
GARTNER INC	17	19	197	22,231	情報技術
SPLUNK INC	26	29	166	18,706	情報技術
WHITEWAVE FOODS CO	36	41	225	25,396	生活必需品
AGCO CORP	17	17	94	10,675	資本財・サービス
DOMINION RESOURCES INC/VA	127	143	1,088	122,354	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	30	93	421	47,340	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	—	34	166	18,698	資本財・サービス
DEERE & CO	66	62	622	69,944	資本財・サービス
AIRGAS INC	15	—	—	—	その他
QUANTA SERVICES INC	49	—	—	—	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	—	36	254	28,568	情報技術
TIME WARNER INC	176.33	176.33	1,638	184,175	一般消費財・サービス
VMWARE INC-CLASS A	19	19	155	17,431	情報技術
BAXALTA INC	116	—	—	—	その他
TEGNA INC	—	45	100	11,316	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	27	27	175	19,720	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	12	—	—	—	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	62	70	508	57,171	公益事業
MEDNAX INC	—	20	132	14,841	ヘルスケア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	26	26	189	21,296	一般消費財・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	21	21	196	22,078	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	184	194.5	1,294	145,472	生活必需品
AMETEK INC	52.25	52.25	240	27,008	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	29	58	260	29,237	生活必需品
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	10	—	—	—	情報技術
LYONDELLBASELL INDU-CL A	86	84	703	79,059	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	94	101.5	1,537	172,848	生活必需品
SCANA CORP	29	31	224	25,248	公益事業
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	26	—	—	—	その他
AFFILIATED MANAGERS GROUP	12	12	174	19,561	金融
WR GRACE & CO	—	16	107	12,053	素材
VALSPAR CORP/THE	—	17	173	19,537	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6.5	7	276	31,092	一般消費財・サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP	66	76	162	18,224	金融
UGI CORP	—	39	180	20,317	公益事業
CUMMINS INC	37	37	511	57,493	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	109	136	516	58,022	情報技術
SABRE CORP	—	46	119	13,460	情報技術
CDW CORP/DE	—	35.5	183	20,664	情報技術
SIGNATURE BANK	—	13	194	21,850	金融
AMERCO	—	1.7	58	6,533	資本財・サービス

銘柄	期 首	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 邦貨換算金額		
	百株	百株	千アメリカ・ドル 千円		
HANESBRANDS INC	85	85	199	22,427	一般消費財・サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	107	122	302	34,027	一般消費財・サービス
TRANSDIGM GROUP INC	11	12	310	34,895	資本財・サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	28	29.5	294	33,100	電気通信サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	76	85	368	41,471	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	393.81	439.81	941	105,808	エネルギー
HCA HOLDINGS INC	71	71	507	57,085	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	88	105.5	243	27,349	エネルギー
T-MOBILE US INC	59.5	67.5	373	42,031	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	18	25	90	10,120	情報技術
COCA-COLA CO/THE	878	946.5	3,894	437,858	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	47	—	—	—	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	40	40	211	23,720	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	25	25	100	11,306	金融
FMC TECHNOLOGIES INC	49	49	161	18,178	エネルギー
FRANKLIN RESOURCES INC	87	87	336	37,850	金融
CSX CORP	208	222	772	86,851	資本財・サービス
FLUOR CORP	33	33	174	19,576	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	22	23.5	300	33,741	ヘルスケア
EXPEDIA INC	21.75	28.75	359	40,433	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	18.5	20	207	23,367	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	84	92.1	7,022	789,504	一般消費財・サービス
FLOWSERVE CORP	29	29	130	14,683	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	23	49	411	46,216	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	889.55	953.05	8,186	920,348	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	31	31	109	12,284	情報技術
AES CORP	143	156	185	20,834	公益事業
L3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	18	18	285	32,099	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	10	10	211	23,822	金融
EOG RESOURCES INC	116	126.5	1,169	131,460	エネルギー
EQT CORP	32	40.5	287	32,312	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	39	42	282	31,767	情報技術
AMERISOURCEBERGEN CORP	44	44	341	38,399	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	72.9	77.9	346	38,953	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	791.23	851.23	1,014	114,068	一般消費財・サービス
MACY'S INC	73.98	73.98	314	35,338	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	34.4	34.4	95	10,692	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	53.87	62.87	201	22,680	一般消費財・サービス
LIBERTY MEDIA CORP - A	21	—	—	—	その他
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	58.2	58.2	157	17,744	一般消費財・サービス
MOBILEYE NV	—	39	146	16,458	情報技術
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	—	3	31	3,556	ヘルスケア
AERCAP HOLDINGS NV	—	38	164	18,548	資本財・サービス
FORTINET INC	—	31	93	10,538	情報技術
MARKEL CORP	—	3.2	289	32,594	金融
NEXTERA ENERGY INC	95	105.5	1,237	139,085	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	223.08	271.08	405	45,620	素材
US BANCORP	379	395	1,939	218,032	金融
UNITED RENTALS INC	22	22	211	23,817	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	16	16	228	25,687	情報技術
FASTENAL CO	60	65	305	34,351	資本財・サービス
FISERV INC	50	52	554	62,281	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	1,994	2,056	6,383	717,675	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	33	36.5	148	16,704	一般消費財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首株数	当株数	期末価額		業種等
			評価	価額	
			外貨建金額 千円	邦貨換算金額 千円	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	56	61.5	191	21,529	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	308	319	1,102	123,974	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	25	27.5	135	15,241	一般消費財・サービス
LINKEDIN CORP - A	23	26	507	57,005	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	60	60.5	1,059	119,113	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	83	83	1,757	197,580	金融
GAMESTOP CORP-CLASS A	23	—	—	—	一般消費財・サービス
ALPHABET INC-CL A	61.5	67.6	5,336	599,942	情報技術
ALPHABET INC-CL C	65.67	70.97	5,470	615,010	情報技術
GENERAL MILLS INC	126	136	852	95,801	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	87.68	99.68	324	36,475	公益事業
GENUINE PARTS CO	33	35	337	37,989	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	—	82.34	293	32,990	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	175	175	444	49,951	金融
MEDIVATION INC	34	—	—	—	その他
HARRIS CORP	25	29.5	308	34,715	情報技術
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	38	30	140	15,814	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	184	197.5	943	106,107	エネルギー
HOME DEPOT INC	275	281.5	3,648	410,198	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	16	14	120	13,546	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	178	246	302	33,960	金融
HERSHEY CO/THE	33	33	323	36,404	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	45	45	269	30,312	一般消費財・サービス
HUMANA INC	32	35	735	82,628	ヘルスケア
STARWOOD HOTELS & RESORTS	38	—	—	—	その他
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	68	672	75,566	情報技術
HELMERICH & PAYNE	23	26	175	19,750	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	18	19	291	32,731	ヘルスケア
HP INC	392	407	616	69,318	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	392	377	894	100,615	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	—	45	160	18,095	一般消費財・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	39	39	107	12,074	エネルギー
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	—	21	76	8,555	一般消費財・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	28	28	230	25,934	金融
HARMAN INTERNATIONAL	14	16	175	19,686	一般消費財・サービス
KRAFT HEINZ CO/THE	128.03	139.53	1,172	131,762	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	199	209.5	3,425	385,145	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	86	91	444	49,964	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	32	36	202	22,744	資本財・サービス
ZOETIS INC	103	107	539	60,686	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	57.29	60.29	452	50,874	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	47	47	183	20,590	エネルギー
LEGGETT & PLATT INC	31	31	150	16,926	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	134.23	145.23	451	50,759	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	—	24.37	52	5,895	一般消費財・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	—	41.05	315	35,511	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	75	82	219	24,686	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	24	27.2	346	38,916	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	591	624	7,018	789,048	ヘルスケア
ABBVIE INC	367.29	373.79	2,302	258,810	ヘルスケア
HOLOGIC INC	51	57.5	224	25,197	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	77	83.5	972	109,359	生活必需品
KROGER CO	200	212	701	78,887	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	33	37	302	33,975	情報技術

銘柄	期首株数	当株数	期末価額		業種等
			評価	価額	
			外貨建金額 千円	邦貨換算金額 千円	
LOCKHEED MARTIN CORP	57	61.5	1,639	184,308	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	17	21	314	35,339	情報技術
L BRANDS INC	53	56	402	45,296	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	203	205	1,449	162,958	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	211	227.5	1,527	171,739	ヘルスケア
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	65	69	387	43,570	電気通信サービス
LAM RESEARCH CORP	33	37	398	44,744	情報技術
RANGE RESOURCES CORP	37	43	156	17,581	エネルギー
JONES LANG LASALLE INC	9	10	101	11,382	不動産
LOEWS CORP	61	65	288	32,459	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	54.49	54.49	345	38,788	金融
MCDONALD'S CORP	205	194	2,341	263,196	一般消費財・サービス
3M CO	135	139	2,401	269,976	資本財・サービス
FACEBOOK INC-A	456	531.5	6,424	722,213	情報技術
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	—	52.54	279	31,464	情報技術
MANPOWERGROUP INC	17	17	144	16,267	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	58	61.5	735	82,696	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	12	14	305	34,389	素材
CONCHO RESOURCES INC	28	32.5	413	46,521	エネルギー
PHILLIPS 66	117	110	906	101,885	エネルギー
MURPHY OIL CORP	36	36	105	11,906	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	93	108	311	35,052	一般消費財・サービス
MATTEL INC	72	78	246	27,674	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	25	26.5	246	27,744	生活必需品
MYLAN NV	87	104.5	376	42,362	ヘルスケア
METLIFE INC	203	213.5	1,156	130,065	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	84	105	150	16,974	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	34.28	36.78	298	33,537	情報技術
MONSANTO CO	102.06	100.56	1,029	115,751	素材
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	6	253	28,444	ヘルスケア
ROCKWELL AUTOMATION INC	28	29.5	387	43,557	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	598.21	638.71	3,972	446,547	ヘルスケア
MASCO CORP	74	74	238	26,795	資本財・サービス
M & T BANK CORP	32.19	33.69	474	53,323	金融
MARSH & MCLENNAN COS	115	121.5	838	94,219	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	47.82	75.22	595	66,897	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	22	26.5	222	25,039	情報技術
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	44	39.5	188	21,186	一般消費財・サービス
TOWERS WATSON & CO-CL A	15	—	—	—	その他
VANTIV INC - CL A	33	35.5	205	23,147	情報技術
FIREEYE INC	22	—	—	—	情報技術
REALOGY HOLDINGS CORP	32	—	—	—	不動産
NETAPP INC	67	67	244	27,499	情報技術
NIKE INC -CL B	146	305.5	1,546	173,885	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	65	67.5	704	79,199	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	45	48.5	320	36,001	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	27	30	213	23,979	金融
ALLY FINANCIAL INC	93	102	196	22,096	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	39	39.5	994	111,814	資本財・サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	62	62	393	44,217	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	115	120	402	45,260	素材
ADT CORP/THE	39.62	—	—	—	その他
MCKESSON CORP	49	51.5	727	81,778	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	60	64	254	28,599	情報技術

銘柄	期首株数	当期株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円	
XYLEM INC	38	42	215	24,240	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	330	358.5	3,248	365,141	生活必需品
NUCOR CORP	68	71.5	440	49,538	素材
WESTERN UNION CO	113.46	113.46	240	26,989	情報技術
NEWELL BRANDS INC	60	101.42	481	54,123	一般消費財・サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	163	175.5	1,185	133,313	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP - C	45	—	—	—	その他
LIBERTY BROADBAND-C	—	26	186	20,995	一般消費財・サービス
PAYCHEX INC	68	75.5	448	50,467	情報技術
PATTERSON COS INC	19	19	73	8,302	ヘルスケア
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21	22	605	68,110	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	420	450.5	2,936	330,105	生活必需品
P G & E CORP	102	115	695	78,164	公益事業
PFIZER INC	1,313.63	1,396.63	4,458	501,173	ヘルスケア
ALKERMES PLC	32	36	209	23,501	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	106	115	465	52,346	公益事業
STRYKER CORP	72	78.5	905	101,848	ヘルスケア
PARKER HANFIFIN CORP	29	30.5	417	46,957	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	32	37.5	651	73,214	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	14	14	121	13,642	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	577.37	581.67	4,821	542,028	生活必需品
EXELON CORP	187.22	213.22	717	80,683	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	48	51	640	72,006	ヘルスケア
CONOCOPHILLIPS	264	286.5	1,267	142,457	エネルギー
PEPSICO INC	314	327	3,353	376,950	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	97	102	1,017	114,404	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	38	40.5	307	34,593	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	134	145.5	1,759	197,822	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	22	22	136	15,301	金融
PENTAIR PLC	40.05	40.05	225	25,308	資本財・サービス
QUALCOMM INC	348	336.5	2,246	252,586	情報技術
PARTNERRE LTD	10	—	—	—	その他
INVESCO LTD	90.5	98.5	304	34,261	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	15.5	17	288	32,451	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	62	66	377	42,433	金融
ENERGEN CORP	17	—	—	—	エネルギー
RAYTHEON COMPANY	66	69	1,038	116,773	資本財・サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	18	18	126	14,177	一般消費財・サービス
RED HAT INC	39	42	336	37,773	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	16	18.1	700	78,799	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	53	56.5	315	35,506	資本財・サービス
PRICELINE GROUP INC/THE	11	11.4	1,733	194,835	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	88	94	644	72,461	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	21	21	179	20,218	素材
RESMED INC	30	32.5	201	22,692	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	31	33	292	32,925	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	28	28	125	14,061	資本財・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	184.78	196.78	1,081	121,582	生活必需品
RITE AID CORP	196	230	185	20,814	生活必需品
RALPH LAUREN CORP	13	13	141	15,872	一般消費財・サービス
AUTONATION INC	17	17	75	8,452	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	27	29	267	30,104	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	288.35	288.35	380	42,724	金融
CHEVRON CORP	400.18	433.18	4,736	532,464	エネルギー

銘柄	期首株数	当期株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円	
EDISON INTERNATIONAL	69	75	533	59,990	公益事業
TESLA MOTORS INC	20	26.7	506	56,901	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	147	147	357	40,190	情報技術
ENDO INTERNATIONAL PLC	43	46	74	8,362	ヘルスケア
STANLEY BLACK & DECKER INC	33.22	34.72	416	46,811	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	34	34	207	23,380	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	18	48.85	1,370	154,037	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	64	71	207	23,274	不動産
TWITTER INC	104	130	236	26,583	情報技術
NAVIENT CORP	87	87	149	16,812	金融
SANDISK CORP	44	—	—	—	その他
SOUTHERN CO/THE	196	217.5	1,050	118,124	公益事業
SYSCO CORP	125	124	668	75,123	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	68.23	67.23	764	85,934	金融
SOUTHWESTERN ENERGY CO	79	110	127	14,332	エネルギー
SEI INVESTMENTS COMPANY	32	32	151	17,059	金融
STERICYCLE INC	18	19.5	147	16,623	資本財・サービス
SCHLUMBERGER LTD	270.67	322.02	2,573	289,322	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	35	39	144	16,217	資本財・サービス
AT&T INC	1,304.91	1,414.91	5,586	627,985	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	38	38	179	20,180	資本財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	17	18.3	505	56,846	素材
SEMPRA ENERGY	50	54	546	61,477	公益事業
TIFFANY & CO	28	28	225	25,370	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	70	70	276	31,084	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	223	230	1,711	192,373	情報技術
SALESFORCE.COM INC	133	147	1,072	120,522	情報技術
SIGNET JEWELERS LTD	197	17	156	17,548	一般消費財・サービス
WESTROCK CO	55.3	59.3	301	33,925	素材
TIME WARNER CABLE	60.53	—	—	—	その他
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	89.25	217.84	988	111,133	資本財・サービス
TESORO CORP	28	28.5	234	26,323	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	188	189	1,900	213,684	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	143	190	284	31,932	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	118	123	565	63,579	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	181	182.5	1,986	223,303	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	150	159.5	1,854	208,501	資本財・サービス
UNUM GROUP	54	54	226	25,508	金融
SPRINT CORP	177.65	177.65	142	15,977	電気通信サービス
ANTERO RESOURCES CORP	—	34	84	9,475	エネルギー
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	19	34.94	282	31,788	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	50	50	189	21,264	金融
AMEREN CORPORATION	51	55	280	31,490	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	203.26	220.26	3,471	390,218	ヘルスケア
VERISIGN INC	22	22	174	19,568	情報技術
VALERO ENERGY CORP	108.92	107.92	688	77,368	エネルギー
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	13	13.9	361	40,692	一般消費財・サービス
FNF GROUP	52.38	57.38	187	21,035	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	20	20	246	27,695	ヘルスケア
ANTHEM INC	57	60.5	878	98,810	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	343	347	3,458	388,810	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	1,030.72	1,107.72	5,744	645,811	金融
FOOT LOCKER INC	29	32	231	26,059	一般消費財・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	96	103	725	81,506	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期 首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
WILLIAMS COS INC	151	167	483	54,313	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	29	31	231	26,050	一般消費財・サービス
WHITING PETROLEUM CORP	44	—	—	—	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	17	17	278	31,262	一般消費財・サービス
WAL-MART STORES INC	343	351.5	2,508	282,023	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	37	46	475	53,471	ヘルスケア
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	168	195	84	9,470	エネルギー
WYNN RESORTS LTD	18	18	179	20,193	一般消費財・サービス
XEROX CORP	229.44	192.44	182	20,465	情報技術
WABTEC CORP	21	21	177	19,944	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	145	153.5	1,209	135,998	一般消費財・サービス
WATERS CORP	18	18	247	27,850	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	20	20	139	15,675	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	83.07	90.57	1,744	196,143	ヘルスケア
WHOLE FOODS MARKET INC	78	78	238	26,841	生活必需品
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	186	212.5	1,817	204,324	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	34	30.83	383	43,108	金融
WESTERN DIGITAL CORP	49	64.5	404	45,442	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	67.3	73.8	428	48,145	公益事業
WESTAR ENERGY INC	—	32	182	20,544	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	109	117.5	503	56,588	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	417	429.5	3,399	382,170	情報技術
PPL CORP	143	154	526	59,192	公益事業
PEPCO HOLDINGS INC	56	—	—	—	その他
PULTEGROUP INC	74	74	142	16,047	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	58	61.5	602	67,755	素材
NORTHERN TRUST CORP	49	49	397	44,696	金融
PRECISION CASTPARTS CORP	30	—	—	—	その他
NVIDIA CORP	116.5	124	1,156	129,991	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	110.93	113.93	1,244	139,940	金融
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	95.5	95.5	205	23,093	一般消費財・サービス
TERADATA CORP	32	—	—	—	情報技術
TYSON FOODS INC-CL A	65	69	406	45,735	生活必需品
NETFLIX INC	86	98	1,151	129,462	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	85	90.5	1,278	143,728	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	71	—	—	—	公益事業
TORCHMARK CORP	26.75	26.75	186	20,951	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	31	34	277	31,163	金融
TEXTRON INC	59	63.5	291	32,823	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	266.5	249.5	710	79,854	一般消費財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	96	103	292	32,838	一般消費財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	83.37	83.37	96	10,815	一般消費財・サービス
OGE ENERGY CORP	42	47	151	17,045	公益事業
OMNICOM GROUP	53	55	485	54,621	一般消費財・サービス
ORACLE CORP	731.83	702.83	2,849	320,394	情報技術
MASTERCARD INC - A	214	224.5	2,330	262,023	情報技術
ONEOK INC	46	49	256	28,886	エネルギー
OCEANEERING INTL INC	21	—	—	—	エネルギー
CENTURYLINK INC	120.95	127.95	309	34,824	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	21	23	416	46,826	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	92	83	527	59,288	一般消費財・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	13	14	320	35,996	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO-B	33	44	440	49,489	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	89	101	350	39,365	エネルギー

銘柄	期 首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
BANK OF AMERICA CORP	2,223.01	2,325.01	4,717	530,335	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	34	38	329	37,037	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	30	169	19,004	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	195	178	1,272	143,056	金融
ANALOG DEVICES INC	67	70	521	58,650	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	60	60	243	27,405	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	285.72	243.22	1,539	173,025	金融
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	14	14	160	18,009	素材
ANADARKO PETROLEUM CORP	109	127	764	85,892	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	41	44	339	38,196	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	38	40.5	335	37,753	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	—	45	175	19,780	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	25	25	131	14,732	ヘルスケア
AVERY DENNISON CORP	19	21	153	17,222	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	131	141.5	787	88,493	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	141	148.5	807	90,817	資本財・サービス
AON PLC	60	62	704	79,214	金融
AMGEN INC	162	174	2,540	285,591	ヘルスケア
CORE LABORATORIES N.V.	10	10	106	11,933	エネルギー
COACH INC	59	64	239	26,908	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	100.86	104.36	685	77,068	資本財・サービス
CELGENE CORP	169	179	2,186	245,764	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	37	41.2	641	72,161	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	260	245	787	88,577	情報技術
CIT GROUP INC	39	45	180	20,316	金融
CIMAREX ENERGY CO	19	22.5	278	31,362	エネルギー
CME GROUP INC	69	78	878	98,797	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	82.44	88.44	306	34,400	エネルギー
ECOLAB INC	58	61.5	715	80,483	素材
EQUIFAX INC	26	27.5	328	36,888	資本財・サービス
GAP INC/THE	50	58	146	16,457	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	311	306	2,291	257,556	ヘルスケア
ST JUDE MEDICAL INC	59	64.5	514	57,791	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	41.48	43.98	393	44,226	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	32	68.5	242	27,314	生活必需品
STATE STREET CORP	89.43	91.93	707	79,588	金融
STAPLES INC	136	156	153	17,204	一般消費財・サービス
SUNTRUST BANKS INC	110.48	115.98	593	66,678	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	252	274	1,053	118,468	金融
IHS INC-CLASS A	15	—	—	—	その他
BAXTER INTERNATIONAL INC	116	114	510	57,363	ヘルスケア
B/E AEROSPACE INC	23	23	137	15,490	資本財・サービス
CAMPBELL SOUP CO	40	46	265	29,812	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	31	31	172	19,390	素材
CHUBB CORP	49	—	—	—	その他
CARDINAL HEALTH INC	71	75.5	535	60,254	ヘルスケア
FEDEX CORP	57	58.5	1,113	125,165	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	116.54	114.04	941	105,896	金融
FMC CORP	28	32	175	19,713	素材
FLEX LTD	122	122	177	19,941	情報技術
CERNER CORP	66	70	348	39,166	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	18	18	218	24,535	素材
CITRIX SYSTEMS INC	34	36.5	320	36,084	情報技術
INTEL CORP	1,004	1,084	3,827	430,299	情報技術

銘柄	期 首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	41	—	—	—	その他
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	88	88	214	24,079	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	92	91	426	48,000	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	70	74	929	104,495	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	553	450	207	23,321	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC	30	33.5	457	51,418	ヘルスケア
CHESAPEAKE ENERGY CORP	119	—	—	—	エネルギー
SEALED AIR CORP	44	44	206	23,243	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	8	8.7	565	63,603	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	—	31	252	28,434	情報技術
SNAP-ON INC	12	13	218	24,524	資本財・サービス
CALPINE CORP	72	72	83	9,332	公益事業
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	43	—	—	—	その他
CARMAX INC	46	46	264	29,740	一般消費財・サービス
COMERICA INC	40	40	247	27,767	金融
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	23	—	—	—	資本財・サービス
INGREDION INC	—	16	192	21,624	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	148.28	158.28	1,208	135,891	公益事業
TARGET CORP	130	129	1,011	113,711	一般消費財・サービス
DOVER CORP	35	35	244	27,456	資本財・サービス
VWV GRAINGER INC	13	13	294	33,080	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	26	29	178	20,121	資本財・サービス
JOHNSON CONTROLS INC	142	—	—	—	その他
CINTAS CORP	21	21	242	27,286	資本財・サービス
CA INC	71.05	71.05	230	25,943	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	90	95	358	40,284	生活必需品
CLOROX COMPANY	28	29.5	347	39,030	生活必需品
ENTERGY CORP	38	42.5	303	34,113	公益事業
MICROSOFT CORP	1,614	1,693.5	10,345	1,163,051	情報技術
INCYTE CORP	34	38.5	404	45,476	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	239.74	247.24	1,876	210,906	生活必需品
MEDTRONIC PLC	301.88	316.38	2,322	261,136	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	230	241	468	52,615	情報技術
BLACKROCK INC	26	28.5	1,050	118,082	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	91	91	219	24,644	公益事業
HASBRO INC	24	26	225	25,318	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	56	61	449	50,485	生活必需品
KEYCORP	184	245	416	46,850	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	24	24	211	23,729	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	347.11	356.11	1,526	171,585	生活必需品
KOHL'S CORP	44	44	238	26,780	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	10	11	187	21,041	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	100	111	176	19,878	金融
APACHE CORP	81.1	87.6	532	59,816	エネルギー
CHUBB LTD	70	107.99	1,384	155,686	金融
ARROW ELECTRONICS INC	20	20	136	15,379	情報技術
ALLSTATE CORP	89	87	605	68,101	金融
EBAY INC	237	250	712	80,127	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC	234	249.5	995	111,886	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	32	35	257	28,994	素材
XILINX INC	56	59.5	321	36,127	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	155.1	143.1	1,099	123,647	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP-A	47	53	305	34,373	一般消費財・サービス
YAHOO! INC	193	210	873	98,210	情報技術

銘柄	期 首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	49	51.5	404	45,512	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	38	38	116	13,076	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	54	59	167	18,797	情報技術
LINEAR TECHNOLOGY CORP	53	56	350	39,391	情報技術
LENNAR CORP-A	39	44	194	21,883	一般消費財・サービス
LEAR CORP	17	17	217	24,474	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	57	65	221	24,895	金融
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	83	—	—	—	資本財・サービス
PROGRESSIVE CORP	128	134	449	50,585	金融
PRAXAIR INC	62	66	806	90,654	素材
PACCAR INC	76.37	79.87	489	55,014	資本財・サービス
PVH CORP	17	19	201	22,647	一般消費財・サービス
EMC CORP/MA	411	—	—	—	その他
BIOGEN INC	50.3	50.8	1,538	172,910	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	—	20	240	27,057	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	321	336	1,954	219,726	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC	31	34	291	32,791	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	66.8	74.8	402	45,198	公益事業
INTUIT INC	57	56	650	73,128	情報技術
BORGWARNER INC	48	48	165	18,595	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	65	71	323	36,413	一般消費財・サービス
BALL CORP	28	37.92	292	32,846	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	288.47	310.47	644	72,493	ヘルスケア
BED BATH & BEYOND INC	36	36	162	18,236	一般消費財・サービス
XL GROUP LTD	63	68	248	27,894	金融
ELECTRONIC ARTS INC	68	70.5	573	64,490	情報技術
VULCAN MATERIALS CO	29	30.5	384	43,247	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	52	56.5	483	54,402	ヘルスケア
VF CORP	71	77.5	431	48,467	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	94.71	94.71	577	64,948	一般消費財・サービス
VIACOM INC-CLASS B	72.71	81.71	301	33,941	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	13	15	300	33,742	一般消費財・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	60	52	84	9,540	情報技術
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	22	22	200	22,595	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	87	80.5	428	48,163	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	452.7	545.7	3,827	430,292	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	84	—	—	—	その他
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	—	58	311	35,059	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	265	166	18,679	不動産
アメリカ・ドル 通 貨 計	株数・金額 67,034.73 585銘柄	株数・金額 71,134.09 584銘柄	445,578	50,091,912	<63.4%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	66	72	318	26,642	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4	4.4	277	23,247	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	30	46.96	142	11,965	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	43.87	53.87	350	29,296	一般消費財・サービス
SILVER WHEATON CORP	90	107	268	22,473	素材
INTACT FINANCIAL CORP	29	31.5	292	24,461	金融
BCE INC	34.3	34.3	200	16,793	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	35	43	342	28,623	素材
SUNCOR ENERGY INC	318.8	393.3	1,586	132,797	エネルギー
METRO INC	55	55	225	18,892	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	70	77	386	32,307	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	266	282	2,078	173,915	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期 首	当	期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	87	91.5	969	81,168	金融
TORONTO-DOMINION BANK	404	437	2,800	234,365	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	67	67	238	19,970	金融
MEG ENERGY CORP	38	—	—	—	エネルギー
ROYAL BANK OF CANADA	315	348.5	3,140	262,812	金融
TOURMALINE OIL CORP	38	47	164	13,737	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	25	25	128	10,725	エネルギー
TRANSCANADA CORP	154	189.5	1,145	95,873	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	75	94	361	30,275	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	366	454	86	7,218	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	245	273	566	47,402	素材
CAE INC	74	58	114	9,604	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	78.04	78.04	454	38,046	金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	178	202	476	39,858	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	39	39	71	5,991	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	14	14	67	5,664	素材
VERESIN INC	62	80	95	8,013	エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	6.9	162	13,565	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	—	97	109	9,131	金融
LINAMAR CORP	—	11	56	4,703	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	—	54	156	13,104	エネルギー
HYDRO ONE LTD	—	40	92	7,755	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	48.6	51.6	360	30,186	生活必需品
CANADIAN UTILITIES LTD-A	28	28	99	8,336	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	81	86	451	37,795	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	48	51	287	24,056	素材
KINROSS GOLD CORP	295	295	133	11,157	素材
BANK OF MONTREAL	143	152	1,354	113,380	金融
POWER CORP OF CANADA	80	87	260	21,833	金融
METHANEX CORP	22	22	120	10,066	素材
CAMECO CORP	92	92	112	9,392	エネルギー
TELUS CORP	54	54	229	19,163	電気通信サービス
POWER FINANCIAL CORP	56	56	188	15,782	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	121	134	453	37,933	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	17	17	241	20,216	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	208	208	95	8,023	素材
AGRIUM INC	29	31	409	34,231	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	243	255	1,062	88,917	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4.5	5.4	343	28,784	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	89	93	508	42,545	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	11	11	123	10,314	生活必需品
BLACKBERRY LTD	119	119	119	9,957	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	132	142.5	732	61,327	金融
ENBRIDGE INC	189	220	1,247	104,364	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAG-CL A	190	205.5	928	77,709	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	425	469	1,082	90,618	金融
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	71	71	163	13,694	ヘルスケア
GOLDCORP INC	177.59	199.59	360	30,146	素材
ENCANA CORP	184	232	352	29,528	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	34	34	680	56,956	資本財・サービス
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	28	22	122	10,289	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	52	52	193	16,217	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	176	183.5	1,647	137,844	資本財・サービス
CGI GROUP INC - CLASS A	49	53	347	29,049	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	千カナダ・ドル	千円	
HUSKY ENERGY INC	74	75.58	111	9,297	エネルギー
ONEX CORPORATION	20	20	189	15,835	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	87	95	252	21,098	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	39	39	101	8,485	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	34	34	190	15,981	資本財・サービス
ELDORADO GOLD CORP	172	172	62	5,224	素材
IGM FINANCIAL INC	23	23	86	7,236	金融
OPEN TEXT CORP	28	28	238	19,955	情報技術
CI FINANCIAL CORP	48	54	144	12,069	金融
SAPUTO INC	58	58	270	22,670	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	147	171	249	20,891	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	90	98	629	52,672	生活必需品
YAMANA GOLD INC	201	233	93	7,818	素材
YAMANA GOLD INC-RTS	-	14.56	0	40	その他
FORTIS INC	61	96	392	32,880	公益事業
CRESCENT POINT ENERGY CORP	105	133	202	16,916	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	183	196	371	31,096	エネルギー
DOLLARAMA INC	27	27	278	23,303	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	-	17	73	6,131	公益事業
ALTAGAS LTD	31	39	125	10,469	エネルギー
FIRST CAPITAL REALTY INC	-	26	52	4,394	不動産
KEYERA CORP	40	40	149	12,481	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	34	39	126	10,560	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	74	81	219	18,409	エネルギー
CANADIAN OIL SANDS LTD	112	-	-	-	その他
ARC RESOURCES LTD	75	83	184	15,453	エネルギー
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 総株数<比率>	8,560.7 84銘柄	9,531 90銘柄	37,543 < 4.0%>	3,141,605
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD	-	375	86	7,257	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD	545	617	160	13,497	金融
BHP BILLITON LIMITED	702	752	1,914	161,093	素材
SOUTH32 LTD	1,182	1,272	356	29,967	素材
LENDELEASE GROUP	121	121	164	13,856	不動産
ASCIANO LTD	216	-	-	-	その他
ALUMINA LTD	699	699	118	9,968	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	161	182	552	46,461	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	397	397	246	20,710	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	118	118	141	11,934	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	570	620	1,783	150,031	金融
WESTPAC BANKING CORP	679.98	780.98	2,436	205,020	金融
SANTOS LTD	220	340	137	11,586	エネルギー
AUSNET SERVICES	-	410	60	5,122	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	602	689	1,935	162,844	金融
RIO TINTO LTD	97	97	585	49,287	素材
ORIGIN ENERGY LTD	364	414	250	21,039	エネルギー
AMCOR LIMITED	267	267	387	32,597	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	468	468	235	19,846	資本財・サービス
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	-	100	43	3,660	電気通信サービス
OIL SEARCH LTD	-	329	217	18,325	エネルギー
SEEK LTD	75	75	110	9,320	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	146	171	185	15,639	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	176	176	343	28,862	素材

銘柄	期 首		当 期		未 期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額				
			外貨建金額 千ドル	邦貨換算金額 千円			
INCITEC PIVOT LTD	456	456	147	12,392	素材		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	370	401	3,118	262,363	金融		
CALTEX AUSTRALIA LTD	60	60	179	15,119	エネルギー		
ORICA LTD	83	83	145	12,200	素材		
QBE INSURANCE GROUP LTD	306	328	364	30,633	金融		
CIMIC GROUP LTD	29	29	90	7,630	資本財・サービス		
WOOLWORTHS LTD	281	300	691	58,182	生活必需品		
COCA-COLA AMATIL LTD	137	137	131	11,100	生活必需品		
TABCORP HOLDINGS LTD	205	205	96	8,089	一般消費財・サービス		
CROWN RESORTS LTD	106	106	122	10,328	一般消費財・サービス		
QANTAS AIRWAYS LTD	145.54	145.54	46	3,894	資本財・サービス		
TELSTRA CORP LTD	936	986	496	41,812	電気通信サービス		
AMP LTD	665	665	315	26,577	金融		
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	114	114	237	19,970	素材		
MACQUARIE GROUP LTD	64.84	72.84	605	50,942	金融		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	126	187	15,754	一般消費財・サービス		
BANK OF QUEENSLAND LTD	—	91	102	8,598	金融		
CSL LTD	103	106	1,048	88,198	ヘルスケア		
WESFARMERS LTD	244.45	267.45	1,124	94,626	生活必需品		
COCHLEAR LTD	17	14	165	13,958	ヘルスケア		
SUNCORP GROUP LTD	287	312	389	32,762	金融		
BORAL LTD	227	227	113	9,588	素材		
BORAL LTD-RTS	—	102.25	2	219	その他		
ASX LTD	42	42	203	17,139	金融		
COMPUTERSHARE LTD	139	139	163	13,718	情報技術		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	140	65	5,536	一般消費財・サービス		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	511	549	309	26,006	金融		
SONIC HEALTHCARE LTD	95	95	206	17,393	ヘルスケア		
TRANSURBAN GROUP	424	478	499	42,028	資本財・サービス		
TRANSURBAN GROUP-RIGHTS	23.55	—	—	—	その他		
ILUKA RESOURCES LTD	120	—	—	—	素材		
CHALLENGER LTD	—	122	130	11,014	金融		
SYDNEY AIRPORT	251	251	156	13,199	資本財・サービス		
TATTS GROUP LTD	369	369	155	13,071	一般消費財・サービス		
AGL ENERGY LTD	152	152	318	26,793	公益事業		
BRAMBLES LTD	349	373	444	37,409	資本財・サービス		
APA GROUP	242	267	213	17,927	公益事業		
DUET GROUP	—	500	119	10,012	公益事業		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	29	33	236	19,908	ヘルスケア		
TPG TELECOM LTD	—	65	45	3,828	電気通信サービス		
REA GROUP LTD	—	12	61	5,214	一般消費財・サービス		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	14	95	8,034	一般消費財・サービス		
オーストラリア・ドル 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	15,529.36 54銘柄	18,405.06 63銘柄	-25,803 < 2.7%>	2,171,113 < 2.7%>		
(香港)	株数	百株	百株	千香港ドル	千円		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	300	330	2,413	35,002	2,413	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	520	550	2,068	29,986	2,068	一般消費財・サービス	
MTR CORP	320	345	1,338	19,409	1,338	資本財・サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	380	350	3,514	50,953	3,514	不動産	
SINO LAND CO	880	880	1,022	14,827	1,022	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	586.69	631.69	5,963	86,465	5,963	資本財・サービス	
WHARF HOLDINGS LTD	290	320	1,760	25,520	1,760	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	125	125	963	13,974	963	不動産	

銘 柄	期 首		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港ドル	千円	
CLP HOLDINGS LTD	410	425	3,240	46,989	公益事業
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	330	330	343	4,985	資本財・サービス
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	258.06	283.86	1,216	17,636	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,494.93	1,811.42	2,626	38,085	公益事業
HANG SENG BANK LTD	168	179	2,620	37,998	金融
WHEELLOCK & CO LTD	250	250	1,076	15,605	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,130	1,290	1,104	16,011	不動産
WH GROUP LTD	—	1,350	854	12,390	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	245	273	5,558	80,595	金融
LI & FUNG LTD	1,320	1,320	447	6,488	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	520	520	895	12,983	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	65	65	487	7,068	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	210	210	582	8,449	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	465	465	641	9,304	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	180	180	376	5,454	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	290.4	290.4	939	13,621	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	—	140	469	6,800	不動産
SJM HOLDINGS LTD	470	470	289	4,204	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	300	300	676	9,809	不動産
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	596.69	641.69	3,333	48,336	不動産
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	150	150	979	14,202	公益事業
PCCW LTD	—	950	424	6,157	電気通信サービス
AIA GROUP LTD	2,628	2,830	13,315	193,069	金融
SANDS CHINA LTD	540	572	2,225	32,263	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	300	300	257	3,736	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	315	315	937	13,588	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	200	200	340	4,930	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	825	875	2,537	36,793	金融
WYNN MACAU LTD	380	380	529	7,680	一般消費財・サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	570	570	566	8,215	電気通信サービス
香 港 ド ル 株数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	18,012.77 35銘柄	21,468.06 38銘柄	-68,937 < 1.3%>	999,599 < 1.3%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	290	300	602	47,571	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	385	415	720	56,860	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	124.7	124.7	122	9,709	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	315	345	185	14,684	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	132	132	76	6,045	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	112	112	92	7,323	不動産
CAPITALAND LTD	590	590	178	14,117	不動産
SEMBCORP MARINE LTD	250	—	—	—	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	410	410	152	12,044	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30	30	118	9,369	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	670	742	669	52,853	金融
GENTING SINGAPORE PLC	1,530	1,530	147	11,659	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,750.5	1,886.5	711	56,164	電気通信サービス
NOBLE GROUP LTD	1,151.81	—	—	—	資本財・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	350	350	115	9,148	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	290	290	79	6,252	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	2,194	2,194	95	7,536	生活必需品
SINGAPORE EXCHANGE LTD	190	190	136	10,773	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	468	468	117	9,239	資本財・サービス
STARHUB LTD	—	160	45	3,626	電気通信サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	期首	当		期末		業種等
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		百株	百株	千円	千円		
WILMAR INTERNATIONAL LTD	560	560	199	15,743	生活必需品		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	690	690	140	11,115	不動産		
シンガポール・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	12,483.01 21銘柄	11,519.2 20銘柄	4,708 ---	371.840 < 0.5%>		
(ニュージーランド)		百株	百株	千円			
MERIDIAN ENERGY LTD	—	260	66	5,362	公益事業		
SPARK NEW ZEALAND LTD	526.89	526.89	184	14,841	電気通信サービス		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	234	234	142	11,454	資本財・サービス		
CONTACT ENERGY LTD	130	130	61	4,934	公益事業		
FLETCHER BUILDING LTD	201	201	217	17,420	素材		
RYMAN HEALTHCARE LTD	—	53	45	3,632	ヘルスケア		
ニュージーランド・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,091.89 4銘柄	1,404.89 6銘柄	718 ---	57.646 < 0.1%>		
(イギリス)		百株	百株	千円			
MERLIN ENTERTAINMENT	141	163	71	10,057	一般消費財・サービス		
TUI AG-DI	107.47	117.47	123	17,374	一般消費財・サービス		
BP PLC	3,979	4,363	1,930	271,206	エネルギー		
UNILEVER PLC	277.6	301.1	942	132,375	生活必需品		
BARCLAYS PLC	3,657	3,975	851	119,621	金融		
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	394	434	292	41,025	資本財・サービス		
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL	36,523.8	—	—	—	その他		
MARKS & SPENCER GROUP PLC	353	381	125	17,569	一般消費財・サービス		
RANDGOLD RESOURCES LTD	19	23	134	18,882	素材		
REXAM PLC	151.6	—	—	—	その他		
PRUDENTIAL PLC	563	602	930	130,767	金融		
INMARSAT PLC	94	103	74	10,438	電気通信サービス		
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	681.91	792.91	156	21,940	金融		
JOHNSON MATTHEY PLC	44.09	45.64	143	20,135	素材		
BAE SYSTEMS PLC	677	761	457	64,294	資本財・サービス		
AVIVA PLC	883.66	939.66	424	59,617	金融		
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,061.02	1,150.02	1,734	243,589	ヘルスケア		
MELROSE INDUSTRIES PLC	240.42	—	—	—	資本財・サービス		
WORLDPAY GROUP PLC	—	427	115	16,283	情報技術		
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	80	56	7,893	ヘルスケア		
AUTO TRADER GROUP PLC	—	252	101	14,264	情報技術		
DCC PLC	—	20	122	17,136	資本財・サービス		
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	—	19,964	1	280	その他		
ROYAL MAIL PLC	171	224	104	14,617	資本財・サービス		
RELX PLC	247.46	256.46	353	49,674	資本財・サービス		
BG GROUP PLC	744	—	—	—	その他		
DIAGEO PLC	549	594	1,194	167,825	生活必需品		
RIO TINTO PLC	276	291.5	894	125,575	素材		
STANDARD CHARTERED PLC	557	783	494	69,430	金融		
TESCO PLC	1,753	1,911	399	56,059	生活必需品		
FRESNILLO PLC	50	50	61	8,666	素材		
SMITH & NEPHEW PLC	193	215	242	34,064	ヘルスケア		
GLENCORE PLC	2,369.25	2,909.25	818	114,968	素材		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	57	57	67	9,503	金融		
SMITHS GROUP PLC	84.33	93.33	130	18,352	資本財・サービス		
BABCOCK INTL GROUP PLC	61	61	57	8,118	資本財・サービス		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	298.83	339.83	119	16,806	金融		
DIXONS CARPHONE PLC	209	248	83	11,683	一般消費財・サービス		
PEARSON PLC	173.63	188.63	146	20,626	一般消費財・サービス		

銘柄	期 首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円		
SAINSBURY (J) PLC	285.25	381.25	88	12,487	生活必需品
NEXT PLC	31	33	162	22,893	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	689	739	110	15,507	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	40.11	43.11	150	21,084	一般消費財・サービス
IMI PLC	58.5	58.5	56	7,871	資本財・サービス
BUNZL PLC	72.55	77.55	159	22,438	資本財・サービス
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	206	206	55	7,748	金融
GKN PLC	365	406	125	17,587	一般消費財・サービス
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	55	—	—	—	一般消費財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	5,773.83	6,261.83	1,216	170,849	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	31	29.93	98	13,797	素材
KINGFISHER PLC	519.11	519.11	185	26,066	一般消費財・サービス
WPP PLC	282	298	512	71,994	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	147.27	159.27	143	20,201	公益事業
SEVERN TRENT PLC	51.33	57.33	127	17,884	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	139	149	1,007	141,539	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	110	119	112	15,828	金融
SCHRODERS PLC	27	32	89	12,531	金融
TATE & LYLE PLC	101	101	69	9,703	生活必需品
AMEC FOSTER WHEELER PLC	86	—	—	—	エネルギー
SSE PLC	214	238	355	49,876	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	48	48	83	11,717	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	212	227	108	15,180	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	276	298	1,265	177,725	ヘルスケア
WOLSELEY PLC	56.15	59.65	275	38,708	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,306	1,436	343	48,186	金融
3I GROUP PLC	210.91	229.91	154	21,717	金融
SKY PLC	222	248	192	26,978	一般消費財・サービス
ASHTED GROUP PLC	112	122	184	25,892	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	241.14	261.14	176	24,777	情報技術
NATIONAL GRID PLC	813.28	888.28	824	115,797	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	12,469.65	15,039.65	867	121,910	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	217.6	242.6	130	18,349	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	207	226.5	796	111,922	生活必需品
CENTRICA PLC	1,071.6	1,283.6	269	37,825	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	—	30	75	10,606	一般消費財・サービス
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	36.5	108	15,200	金融
ARM HOLDINGS PLC	305	—	—	—	その他
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	406.6	435.6	1,940	272,545	生活必需品
ICAP PLC	120	120	58	8,191	金融
SABMILLER PLC	210	—	—	—	その他
BHP BILLITON PLC	455.77	501.77	659	92,573	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	77	85	217	30,528	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	4,255	4,633	2,927	411,144	金融
SHIRE PLC	128	210.74	994	139,744	ヘルスケア
OLD MUTUAL PLC	1,040.25	1,170.25	221	31,148	金融
ANGLO AMERICAN PLC	298.83	334.83	403	56,647	素材
MONDI PLC	75	83	135	19,037	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	509	509	112	15,743	生活必需品
CARNIVAL PLC	41.61	45.11	186	26,161	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	35	35	35	4,970	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	366.41	388.41	540	75,942	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	68	75.5	130	18,282	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	1,826	2,000	708	99,544	電気通信サービス

銘柄	株数	期首		当		期末		業種等
		株数	株数	株数	株数	評価価額		
						外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千円	千円			
COCA-COLA HBC AG-DI	44	44	73	10,351		生活必需品		
WILLIAM HILL PLC	192	192	58	8,147		一般消費財・サービス		
BURBERRY GROUP PLC	95.89	104.89	147	20,743		一般消費財・サービス		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	50.73	44.77	148	20,915		一般消費財・サービス		
AGGREKO PLC	54.68	—	—	—		資本財・サービス		
CAPITA PLC	142.9	150.9	84	11,816		資本財・サービス		
TRAVIS PERKINS PLC	53	59	80	11,353		資本財・サービス		
INTERTEK GROUP PLC	35	38	123	17,346		資本財・サービス		
ITV PLC	825	868	148	20,872		一般消費財・サービス		
PETROFAC LTD	56	56	43	6,056		エネルギー		
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	66.49	75.49	209	29,434		金融		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	849	1,000	1,949	273,756		エネルギー		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	533.81	881.18	1,790	251,439		エネルギー		
MEGGITT PLC	177	177	83	11,719		資本財・サービス		
G4S PLC	346	346	82	11,654		資本財・サービス		
COBHAM PLC	256	386	63	8,935		資本財・サービス		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	33	55	7,736		ヘルスケア		
ADMIRAL GROUP PLC	46	52	98	13,870		金融		
INVESTEC PLC	123	145	75	10,621		金融		
ANTOFAGASTA PLC	86	86	60	8,455		素材		
STANDARD LIFE PLC	424.63	454.63	158	22,209		金融		
EXPERIAN PLC	209.54	230.54	345	48,572		資本財・サービス		
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	99,273.49 107銘柄	89,754.12 106銘柄	39,793 < 7.1%>	5,589,335			
(イスラエル)		百株	百株	千円	千円			
AZRIELI GROUP LTD	—	10	164	4,829		不動産		
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	564	564	398	11,681		電気通信サービス		
ISRAEL CHEMICALS LTD	140	140	201	5,910		素材		
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	189	—	—	—		ヘルスケア		
BANK HAPOLIM BM	265	265	613	17,987		金融		
BANK LEUMI LE-ISRAEL	376	376	583	17,120		金融		
NICE LTD	17	17	430	12,615		情報技術		
イスラエル・シェケル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,551 6銘柄	1,372 6銘柄	2,392 < 0.1%>	70,144			
(スイス)		百株	百株	千円	千円			
DUFREY AG-REG	9	10.5	130	14,501		一般消費財・サービス		
UBS GROUP AG-REG	802	860	1,357	150,880		金融		
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	—	2	101	11,288		素材		
ADECCO GROUP AG-REG	37	40	250	27,777		資本財・サービス		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSEIN	153.5	165	3,735	415,062		ヘルスケア		
PARGESA HOLDING SA-BR	8	8	51	5,671		金融		
SIKA AG-BR	0.54	0.54	263	29,327		素材		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.02	117	13,015		生活必需品		
ABB LTD-REG	483	439	907	100,871		資本財・サービス		
ARYZTA AG	21	21	92	10,259		生活必需品		
TRANSOCEAN LTD	84.5	—	—	—		エネルギー		
SWISS RE AG	78	78	726	80,685		金融		
NESTLE SA-REG	699.5	727	4,965	551,706		生活必需品		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3.5	4.2	209	23,251		金融		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	10	179	19,966		資本財・サービス		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	341.2	435.2	585	65,085		金融		
JULIUS BAER GROUP LTD	52	52	231	25,716		金融		
SULZER AG-REG	6.5	—	—	—		資本財・サービス		
SGS SA-REG	1.3	1.3	262	29,220		資本財・サービス		
SCHINDLER HOLDING AG-REG	—	5	88	9,838		資本財・サービス		
GALENICA AG-REG	—	0.9	95	10,619		ヘルスケア		

銘柄	株数	株数	期 末		業 種 等
			評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		株数	百株	千円	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7	7.5	221	24,649	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	33.32	35.12	930	103,407	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	12	12	149	16,573	金融
NOVARTIS AG-REG	496.5	522	3,656	406,285	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	—	0.5	60	6,744	生活必需品
CE FINANCIERE RICHEMONT-REG	114.5	123.5	805	89,467	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	5.5	5.9	255	28,418	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG	8	9	360	40,069	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	2.1	2.2	400	44,488	素材
ACTELION LTD-REG	23	22.5	470	52,249	ヘルスケア
SYNGENTA AG-REG	20.12	21.62	829	92,220	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	13	13	160	17,795	ヘルスケア
LONZA GROUP AG-REG	13	13	234	26,100	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	11	11	63	7,070	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	95.4	108.4	569	63,292	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	8	8	224	24,897	金融
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	12.5	12.5	165	18,374	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	14	16	133	14,870	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	—	0.23	116	12,994	生活必需品
スイス・フラン 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,679.5 35銘柄	3,803.63 38銘柄	24,162 < 3.4%>	2,684,721
(デンマーク)		百株	百株	千円	千円
NOVO NORDISK A/S-B	428	450	10,354	166,603	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	152.5	163.5	3,368	54,192	金融
ISS A/S	—	39	947	15,242	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.95	0.95	842	13,550	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52	52	2,445	39,340	資本財・サービス
TDC A/S	193	193	690	11,117	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B	24.5	24.5	1,460	23,494	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	55	55	1,310	21,088	素材
COLOPLAST-B	25	28	1,236	19,890	ヘルスケア
DSV A/S	42	46	1,444	23,247	資本財・サービス
WILLIAM DEMANT HOLDING	6.75	33.75	391	6,299	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1.6	1.6	1,496	24,083	資本財・サービス
PANDORA A/S	25	26.5	2,232	35,922	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	—	23.5	933	15,026	素材
GENMAB A/S	—	13	1,608	25,874	ヘルスケア
デンマーク・クローネ 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,006.3 12銘柄	1,150.3 15銘柄	30,762 < 0.6%>	494,974
(ノルウェー)		百株	百株	千円	千円
NORSK HYDRO ASA	299	334	1,352	17,828	素材
DNB ASA	211.5	225.5	2,753	36,289	金融
ORKLA ASA	190.5	190.5	1,458	19,220	生活必需品
TELENOR ASA	158	178	2,255	29,724	電気通信サービス
STATOIL ASA	241.73	261.73	3,656	48,190	エネルギー
SCHIBSTED ASA-CL A	—	15	275	3,635	一般消費財・サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	37.6	41.6	1,321	17,419	素材
MARINE HARVEST	—	87	1,345	17,738	生活必需品
GIENSIDIGE FORSKRING ASA	39.5	48.5	671	8,853	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	18	315	4,163	一般消費財・サービス
ノルウェー・クローネ 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,177.83 7銘柄	1,399.83 10銘柄	15,406 < 0.3%>	203,063

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB	13	19	518	6,356	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	655.3	722.3	3,406	41,727	情報技術
VOLVO AB-B SHS	324	345	3,372	41,311	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	15	15	587	7,195	電気通信サービス
SKF AB-B SHARES	86.5	86.5	1,403	17,197	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	54.5	54.5	1,167	14,300	一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB	654.5	706.5	6,743	82,608	金融
SWEDISH MATCH AB	45.5	45.5	1,322	16,197	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	89.5	89.5	627	7,685	電気通信サービス
GETINGE AB-B SHS	47	47	677	8,296	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A SHS	320.5	341.5	3,114	38,152	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	321	352	4,403	53,943	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	199	213	4,498	55,107	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	208	217	5,815	71,241	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	124	141	3,443	42,179	生活必需品
SKANSKA AB-B SHS	82.5	82.5	1,723	21,111	資本財・サービス
SANDVIK AB	223.5	244.5	2,650	32,467	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	101	108	3,333	40,841	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	144	157	4,322	52,947	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	92	92	1,213	14,865	資本財・サービス
TELIA CO AB	558	600	2,080	25,489	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB	70	70	967	11,850	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	83	91	2,224	27,255	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	211	233	3,961	48,522	資本財・サービス
LUNDIN PETROLEUM AB	64	64	1,054	12,920	エネルギー
BOLIDEN AB	60	60	1,426	17,478	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	125.5	125.5	852	10,446	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B	53	53	1,187	14,549	金融
HEXAGON AB-B SHS	55.5	62	1,957	23,985	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	—	35	559	6,851	金融
スウェーデン・クロス 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,080.3 29銘柄	5,472.8 30銘柄	70,619 865,083 < 1.1%>	
ユーロ (アイルランド)	株数	株数	千ユーロ	千円	
BANK OF IRELAND	6,618	6,618	132	15,843	金融
KERRY GROUP PLC-A	34	38.5	256	30,692	生活必需品
CRH PLC	175	194	604	72,347	素材
PADDY POWER BETFAIR PLC	—	19	191	22,924	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,827 3銘柄	6,869.5 4銘柄	1,184 141,808 < 0.2%>	
ユーロ (オランダ)	株数	株数	千ユーロ	千円	
QIAGEN N.V.	48.5	54.5	140	16,863	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	204.76	218.76	602	72,075	資本財・サービス
NN GROUP NV	48	76	230	27,600	金融
UNILEVER NV-CVA	351.5	383.5	1,419	169,963	生活必需品
HEINEKEN NV	51	53	376	45,119	生活必需品
RELX NV	214.19	234.19	358	42,889	資本財・サービス
AEGON NV	407.44	407.44	193	23,209	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	192.93	298.83	565	67,676	生活必需品
AKZO NOBEL	55	58	339	40,621	素材
KONINKLIJKE DSM NV	38	44	251	30,047	素材
WOLTERS KLUWER	69	69	233	27,949	資本財・サービス
BOSKALIS WESTMINSTER	21	21	61	7,337	資本財・サービス
ING GROEP NV	847.5	918.5	1,159	138,804	金融

銘柄	株数	期首		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE KPN NV	684.5	782.5	212	25,383	電気通信サービス	
ASML HOLDING NV	74.3	86.8	846	101,354	情報技術	
TNT EXPRESS NV	101.95	—	—	—	その他	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	—	54	107	12,817	金融	
VOPAK	20	16	69	8,285	エネルギー	
RANDSTAD HOLDING NV	26.5	30	144	17,272	資本財・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	23	23	152	18,225	生活必需品	
GEMALTO	17	20	97	11,718	情報技術	
OCI NV	23	—	—	—	素材	
ALTICE NV - A	57	89	142	17,055	一般消費財・サービス	
ALTICE NV - B	19	29	46	5,581	一般消費財・サービス	
AIRBUS GROUP SE	128	136	821	98,375	資本財・サービス	
CNH INDUSTRIAL NV	209	243	195	23,356	資本財・サービス	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	193.5	193.5	139	16,699	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	—	28.35	146	17,595	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,125.57 26銘柄	4,567.87 26銘柄	9,054 1,083,881 < 1.4%>		
ユーロ (ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UCB SA	27.5	27.5	169	20,244	ヘルスケア	
KBC GROEP NV	54.5	58	324	38,823	金融	
COLRUYT SA	20	20	96	11,598	生活必需品	
DELHAIZE GROUP	23	—	—	—	その他	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	17	17	130	15,623	金融	
SOLVAY SA	12.5	17	179	21,508	素材	
UMICORE	29.5	22.5	123	14,783	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	174	179	1,770	211,906	生活必需品	
AGEAS	47.9	47.9	169	20,299	金融	
PROXIMUS	35	35	93	11,144	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	—	12	60	7,209	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	440.9 10銘柄	435.9 10銘柄	3,117 373,141 < 0.5%>		
ユーロ (ルクセンブルグ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
RTL GROUP	10	10	64	7,761	一般消費財・サービス	
ARCELORMITTAL	213	423	298	35,706	素材	
SES	69.5	83.5	173	20,729	一般消費財・サービス	
TENARIS SA	105.5	105.5	149	17,856	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	398 4銘柄	622 4銘柄	685 82,053 < 0.1%>		
ユーロ (フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA	—	16	39	4,697	一般消費財・サービス	
SFR GROUP SA	23	23	53	6,425	電気通信サービス	
TOTAL SA	471	521.5	2,290	274,164	エネルギー	
MICHELIN (CGDE)	40	42	425	50,977	一般消費財・サービス	
AIR LIQUIDE SA	75.48	90.48	858	102,726	素材	
KERING	16	18	367	44,029	一般消費財・サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	123	132	820	98,199	資本財・サービス	
BOUYGUES SA	42.5	46.5	148	17,736	資本財・サービス	
BNP PARIBAS	231.5	249	1,354	162,111	金融	
PEUGEOT SA	93.5	112.5	156	18,785	一般消費財・サービス	
NATIXIS	201.5	229.5	107	12,848	金融	
THALES SA	22.5	25.5	235	28,176	資本財・サービス	
DANONE	126	138	826	98,913	生活必需品	
CARREFOUR SA	121	129	286	34,271	生活必需品	
SUEZ	63.75	74.75	98	11,842	公益事業	

銘柄	株数	期首	当		期末		業種等
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		百株	百株	千ユーロ	千円		
VIVENDI	250.41	237.41	427	51,152	一般消費財・サービス		
L'OREAL	55	59.5	958	114,773	生活必需品		
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	105	115	466	55,894	資本財・サービス		
LEGRAND SA	57.17	63.67	329	39,440	資本財・サービス		
ALCATEL-LUCENT SA	602	—	—	—	その他		
CASINO GUICHARD PERRACHON	13	13	55	6,673	生活必需品		
PERNOD RICARD SA	47.17	49.17	482	57,708	生活必需品		
SOCIETE BIC SA	6	7	85	10,218	資本財・サービス		
EURAZEO	10.24	10.75	54	6,545	金融		
REXEL SA	60.5	70.5	101	12,139	資本財・サービス		
SOCIETE GENERALE SA	158	180	718	85,968	金融		
LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUI	60.5	65.5	1,118	133,873	一般消費財・サービス		
ACCOR SA	44	40	134	16,046	一般消費財・サービス		
CAPGEMINI	35	39	295	35,381	情報技術		
VALEO SA	16.5	56.5	298	35,688	一般消費財・サービス		
PUBLICIS GROUPE	41	46	281	33,714	一般消費財・サービス		
BUREAU VERITAS SA	60.5	60.5	106	12,742	資本財・サービス		
EIFFAGE	—	13	81	9,748	資本財・サービス		
SODEXO	20.5	23	235	28,191	一般消費財・サービス		
INGENICO GROUP	12	12	88	10,609	情報技術		
ZODIAC AEROSPACE	42	48	100	11,982	資本財・サービス		
ESSILOR INTERNATIONAL	44.5	49	490	58,682	ヘルスケア		
AXA SA	429	455	1,001	119,819	金融		
CHRISTIAN DIOR SE	12	13	237	28,375	一般消費財・サービス		
LAGARDERE SCA	26.5	26.5	61	7,311	一般消費財・サービス		
TECHNIP SA	22	25.5	158	18,933	エネルギー		
EDENRED	47.5	47.5	94	11,337	資本財・サービス		
RENAULT SA	41.5	46	340	40,751	一般消費財・サービス		
HERMES INTERNATIONAL	5.7	6.2	237	28,472	一般消費財・サービス		
REMY COINTREAU	—	5.5	42	5,091	生活必需品		
ATOS SE	18	21.5	211	25,277	情報技術		
DASSAULT SYSTEMES SA	28	30.5	221	26,490	情報技術		
WENDEL	6	6	64	7,767	金融		
ORANGE	433	469	645	77,303	電気通信サービス		
ALSTOM	46.5	36.5	94	11,291	資本財・サービス		
CNP ASSURANCES	37.5	37.5	61	7,399	金融		
SANOFI	254.25	273.75	2,089	250,084	ヘルスケア		
VINCI SA	103.5	118.5	727	87,049	資本財・サービス		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	93.5	105.5	172	20,609	公益事業		
CREDIT AGRICOLE SA	221	257	273	32,762	金融		
ENGIE	316.73	341.73	397	47,572	公益事業		
IMERYS SA	9	9	59	7,076	素材		
EDF	55.5	55.5	54	6,581	公益事業		
SAFRAN SA	63.5	74	474	56,778	資本財・サービス		
ILIAD SA	6	6	106	12,704	電気通信サービス		
ARKEMA	15.5	15.5	137	16,432	素材		
ADP	7.5	7.5	69	8,292	資本財・サービス		
EUTELSAT COMMUNICATIONS	40.5	40.5	68	8,214	一般消費財・サービス		
SCOR SE	34	41	122	14,622	金融		
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	104.5	104.5	86	10,329	資本財・サービス		
BOLLORE	166	190	57	6,934	資本財・サービス		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,035.9 63銘柄	5,972.41 65銘柄	23,347 < 3.5% >	2,794,752		

銘柄	期 首	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千ユーロ		邦貨換算金額 千円
ユーロ (ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	180.5	195.5	1,735	207,733	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	30	38	98	11,799	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	299.5	321.5	471	56,416	金融
COMMERZBANK AG	229.85	246.85	158	18,949	金融
VOLKSWAGEN AG	8	8	103	12,444	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	35.5	43.5	533	63,837	一般消費財・サービス
MAN SE	8.5	8.5	79	9,500	資本財・サービス
SIEMENS AG-REG	173	179	1,899	227,333	資本財・サービス
E.ON SE	445	465	289	34,620	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	72.5	77.5	629	75,327	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	42	42	147	17,688	資本財・サービス
OSRAM LIGHT AG	19.1	21.6	102	12,329	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	24.5	25.5	428	51,264	一般消費財・サービス
BASF SE	201	216.5	1,703	203,899	素材
LINDE AG	40.5	44	660	79,054	素材
K+S AG-REG	44	44	83	9,964	素材
ALLIANZ SE-REG	98.5	106.8	1,606	192,270	金融
THYSSENKRUPP AG	78	85	178	21,417	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	39	42	454	54,421	生活必需品
RWE AG	108	118	141	16,977	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50.5	50.5	62	7,510	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	9	9	49	5,865	資本財・サービス
BRENTTAG AG	34	36.5	178	21,314	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	84	97	662	79,325	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	27	27	97	11,722	情報技術
HOCHTIEF AG	—	5	66	7,924	資本財・サービス
SAP SE	214.92	231.42	1,844	220,749	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	36.5	38.7	669	80,094	金融
SCHAEFFLER AG	—	38	46	5,567	一般消費財・サービス
ZALANDO SE	—	19	68	8,152	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	31	33	277	33,208	素材
COVESTRO AG	—	16	94	11,251	素材
INNOGY SE	—	34	114	13,658	公益事業
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PREF	34	37	178	21,334	一般消費財・サービス
BEIERSDORF AG	21.5	23	177	21,256	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF	—	15	55	6,701	素材
MERCK KGAA	29	31	295	35,359	ヘルスケア
ADIDAS AG	45.7	44.2	616	73,752	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	22	24	226	27,093	生活必需品
METRO AG	37	41	114	13,675	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	694	754	1,114	133,395	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAWMLER AG-REGISTERED SHARES	48.5	50.5	373	44,731	ヘルスケア
INFINEON TECHNOLOGIES AG	210.5	225	1,429	171,129	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	247.5	270	432	51,758	情報技術
HANNOVER RUECK SE	14	14	140	16,774	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	212	231	676	80,975	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	41.5	—	—	—	金融
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	—	46	347	41,643	金融
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	47.5	50.5	160	19,222	一般消費財・サービス
LANXESS AG	19.5	22	127	15,207	素材
AXEL SPRINGER SE	—	10	40	4,895	一般消費財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	76.5	82	240	28,739	不動産
SYMRISE AG	28	30	170	20,443	素材
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	5.5	—	—	—	一般消費財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄		期 首		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外貨建金額	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		百株	百株	千ユーロ	千円	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PPF		128	165	59	7,131	一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD		—	12	82	9,835	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		14	16.5	89	10,730	不動産
		104	109	336	40,237	
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,744.07 49銘柄	5,266.57 56銘柄	23,221	2,779,621 < 3.5%>	
ユーロ (ポルトガル)		百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS		60	60	89	10,704	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		495	495	134	16,057	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		103.5	103.5	126	15,133	エネルギー
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	658.5 3銘柄	658.5 3銘柄	350	41,895 < 0.1%>	
ユーロ (スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA		969.27	1,046.27	826	98,925	電気通信サービス
ENDESA SA		68.5	76.5	149	17,888	公益事業
BANCO POPULAR ESPANOL		404.73	754.73	59	7,109	金融
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		1,371.12	1,534.12	886	106,140	金融
IBERDROLA SA		1,162.34	1,271.34	728	87,214	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		1,077.16	1,319.09	151	18,189	金融
BANKINTER SA		131	151	104	12,561	金融
REPSOL SA		223	257	310	37,161	エネルギー
GRIFOLS SA		33.5	67	123	14,796	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		3,121.5	3,438.5	1,465	175,418	金融
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		101	149	185	22,213	資本財・サービス
AMADEUS IT GROUP SA		96	100	428	51,321	情報技術
GAS NATURAL SDG SA		74.5	84.5	137	16,466	公益事業
MAPFRE SA		214.5	214.5	60	7,245	金融
CAIXABANK S.A		538	748	203	24,335	金融
CAIXABANK S.A-RTS		—	748	2	349	その他
ZARDOYA OTIS SA		45.5	45.5	33	3,986	資本財・サービス
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		180	180	94	11,294	資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		37.76	44.76	122	14,704	資本財・サービス
AENA SA		14.5	16	203	24,380	資本財・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		239	253	821	98,287	一般消費財・サービス
ENAGAS SA		47	54	126	15,173	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		25	100	169	20,343	公益事業
FERROVIAL SA		98	117	195	23,402	資本財・サービス
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		187	157	70	8,434	生活必需品
BANKIA SA		1,084.22	1,084.22	89	10,668	金融
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	11,544.1 25銘柄	14,011.03 26銘柄	7,752	928,014 < 1.2%>	
ユーロ (イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNIPOLSAI SPA		217.5	217.5	38	4,605	金融
BANCO POPOLARE SC		83	—	—	—	金融
PRYSMIAN SPA		57	48	108	12,973	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		253.43	278.43	324	38,793	金融
SAIPEM SPA		61	1,343	51	6,219	エネルギー
MEDIOBANCA SPA		146.15	146.15	91	10,977	金融
UNICREDIT SPA		1,037.69	1,235.69	239	28,694	金融
TELECOM ITALIA SPA		2,457.82	2,582.82	181	21,734	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP		1,349.5	1,349.5	78	9,385	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO-RSP		—	210	39	4,776	金融
INTESA SANPAOLO		2,745.97	2,985.97	608	72,842	金融
ATLANTIA SPA		89.07	99.07	201	24,156	資本財・サービス

銘 柄		期 首		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
		株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
POSTE ITALIANE SPA		百株	百株	千ユーロ	千円	金融
ENI SPA		—	118	67	8,135	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA		544	598	757	90,621	エネルギー
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA		112.25	95.25	116	13,886	資本財・サービス
ENEL SPA		508.15	—	—	—	金融
SNAM SPA		1,515	1,778.34	673	80,676	公益事業
LUXOTTICA GROUP SPA		444	582	204	24,480	エネルギー
UBI BANCA SPA		37	37	179	21,484	一般消費財・サービス
TERNA SPA		196	—	—	—	金融
ENEL GREEN POWER SPA		322	354	142	17,110	公益事業
EXOR SPA		404	—	—	—	その他
		21	25	98	11,823	金融
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	12,601.53 21銘柄	14,083.72 19銘柄	4,205	503,378 < 0.6%>	
ユーロ (フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ		113	124	266	31,882	素材
NOKIA OYJ		776.5	1,358.5	546	65,370	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		32	32	127	15,244	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		131	131	118	14,222	素材
METSO OYJ		30	30	78	9,437	資本財・サービス
ELISA OYJ		35.5	35.5	106	12,701	電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS		96.5	103	427	51,116	金融
FORTUM OYJ		94.5	104.5	143	17,136	公益事業
KONE OYJ-B		66.5	78.5	323	38,685	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ		30	30	100	12,054	一般消費財・サービス
NESTE OYJ		34.5	29.5	112	13,467	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		20.5	20.5	82	9,884	ヘルスケア
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,460.5 12銘柄	2,077 12銘柄	2,432	291,203 < 0.4%>	
ユーロ (オーストリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG		35.5	35.5	105	12,609	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		55.5	66.5	171	20,528	金融
VOESTALPINE AG		28.5	28.5	101	12,190	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL		24	24	40	4,895	金融
ANDRITZ AG		16	16	77	9,230	資本財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	159.5 5銘柄	170.5 5銘柄	496	59,455 < 0.1%>	
ユーロ (その他)		百株	百株	千ユーロ	千円	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		—	52	162	19,460	生活必需品
STMICROELECTRONICS NV		137	153	142	17,052	情報技術
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	137 1銘柄	205 2銘柄	305	36,512 < 0.0%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	49,132.57 222銘柄	54,940 232銘柄	76,154	9,115,717 < 11.5%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	283,613.45 1,201銘柄	291,354.98 1,238銘柄	—	75,856,759 < 96.0%>	

(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) 外国投資信託証券

銘柄	期 首		当 期		期 末	
	口 数	口 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.847	3.197	526	59,215		
SIMON PROPERTY GROUP INC	6.587	7.187	1,310	147,291		
BOSTON PROPERTIES INC	3.3	3.6	450	50,694		
GENERAL GROWTH PROPERTIES	12.1	13.6	348	39,231		
VORNADO REALTY TRUST	3.627	3.827	379	42,635		
EQUITY RESIDENTIAL	7.9	8.5	514	57,802		
EQUINIX INC	1.158	1.608	552	62,075		
AMERICAN TOWER CORP	9.1	9.75	1,033	116,240		
HOTEL & RESORTS INC	16.093	17.293	299	33,632		
KIMCO REALTY CORP	8.7	10	260	29,274		
PLUM CREEK TIMBER CO	3.7	—	—	—		
VENTAS INC	7	7.9	482	54,237		
WEYERHAEUSER CO	11.094	17.614	548	61,701		
AGNC INVESTMENT CORP	7.8	7.8	148	16,669		
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	6.9	172	19,446		
CROWN CASTLE INTL CORP	7.2	7.75	660	74,257		
IRON MOUNTAIN INC	3.91	5.61	189	21,272		
VEREIT INC	20.4	22.3	189	21,359		
PROLOGIS INC	11.062	12.262	630	70,909		
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	—	1.7	189	21,351		
CAMDEN PROPERTY TRUST	1.8	2	158	17,820		
DUKE REALTY CORP	7.3	8	206	23,212		
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.4	1.48	319	35,916		
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1.5	1.6	226	25,505		
WELLTOWER INC	7.4	8.3	532	59,894		
HCP INC	9.7	10.7	316	35,605		
LIBERTY PROPERTY TRUST	3.3	3.3	131	14,739		
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	1.7	159	17,928		
MACERICH CO/THE	3	3	207	23,321		
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	19.8	23.2	240	27,046		
REALTY INCOME CORP	4.8	6	340	38,272		
PUBLIC STORAGE	3.1	3.4	712	80,118		
REGENCY CENTERS CORP	2.1	2.3	153	17,298		
SL GREEN REALTY CORP	2.1	2.25	238	26,819		
UDR INC	5.7	6.3	215	24,214		
DIGITAL REALTY TRUST INC	2.8	3.7	345	38,891		
EXTRA SPACE STORAGE INC	2.3	2.75	194	21,903		
アメリカ・ドル 通 貨 計	221,678 34銘柄	258,378 36銘柄	13,590	1,527,811 <1.9%>		
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	—	1.5	47	3,952		
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	—	3	65	5,470		
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	—	3.3	88	7,442		
カナダ・ドル 通 貨 計	— 3銘柄	7.8 3銘柄	201	16,864 <0.0%>		
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円		
SCENTRE GROUP	116.322	121.922	513	43,188		
DEXUS PROPERTY GROUP	23.95	23.95	216	18,176		
GPT GROUP	40.06	40.06	189	15,943		
MIRVAC GROUP	93.4	93.4	190	16,031		
STOCKLAND	51.5	57	244	20,574		
WESTFIELD CORP	43.096	45.496	414	34,911		
GOODMAN GROUP	38.2	41.7	273	23,051		

銘柄	期 首		当 期		期 末	
	口 数	口 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額
			外貨建金額	邦貨換算金額		
VICINITY CENTRES	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円		
	74.873	74.873	213	17,954		
オーストラリア・ドル 通 貨 計	481,401 8銘柄	498,401 8銘柄	2,256	189,832 <0.2%>		
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円		
LINK REIT	49.5	52	2,750	39,886		
香 港 ・ ド ル 通 貨 計	49.5 1銘柄	52 1銘柄	2,750	39,886 <0.1%>		
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	48	48	110	8,756		
CAPITALAND MALL TRUST	63.2	63.2	120	9,532		
SUNTEC REIT	—	53	88	7,010		
シンガポール・ドル 通 貨 計	111.2 2銘柄	164.2 3銘柄	320	25,299 <0.0%>		
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円		
LAND SECURITIES GROUP PLC	17.1	18.2	177	24,924		
SEGRO PLC	16.75	19.95	83	11,729		
HAMMERSON PLC	17.4	17.4	95	13,442		
BRITISH LAND CO PLC	20.9	22.1	132	18,624		
INTU PROPERTIES PLC	21.1	21.1	57	8,049		
イギリス・ポンド 通 貨 計	93.25 5銘柄	98.75 5銘柄	546	76,770 <0.1%>		
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円		
UNIBAIL-RODAMCO SE	2.15	2.36	497	59,577		
ICADE	0.75	0.75	48	5,815		
GEICINA SA	0.75	0.95	116	13,992		
KLEPIERRE	4.15	5.2	183	22,003		
FONCIERE DES REGIONS	0.75	0.75	55	6,647		
国 小 計	8.55 5銘柄	10.01 5銘柄	902	108,036 <0.1%>		
合 計	965,579 55銘柄	1,089,539 61銘柄	—	1,984,502 <2.5%>		

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国 S & P 500 (アメリカ)	百万円 1,114	百万円 —

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	75,856,759	95.3
投資信託証券	1,984,502	2.5
コール・ローン等、その他	1,789,729	2.2
投資信託財産総額	79,630,991	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＝112.42円、1カナダ・ドル＝83.68円、1オーストラリア・ドル＝84.14円、1香港ドル＝14.50円、1シンガポール・ドル＝78.97円、1ニュージーランド・ドル＝80.25円、1イギリス・ポンド＝140.46円、1イスラエル・シェケル＝29.32円、1スイス・フラン＝111.11円、1デンマーク・クローネ＝16.09円、1ノルウェー・クローネ＝13.18円、1スウェーデン・クローネ＝12.25円、1ユーロ＝119.70円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（78,796,718千円）の投資信託財産総額（79,630,991千円）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

2016年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	資 産	負 債
(A) 資産	79,630,991,270円	
コール・ローン等	775,049,476	
株式(評価額)	75,856,759,279	
投資信託証券(評価額)	1,984,502,691	
未収入金	339,367,491	
未収配当金	162,157,303	
差入委託証拠金	513,155,030	
(B) 負債	624,937,800	
未払解約金	624,937,800	
(C) 純資産総額(A－B)	79,006,053,470	
元本	40,539,431,105	
次期繰越損益金	38,466,622,365	
(D) 受益権総口数	40,539,431,105口	
1万口当り基準価額(C／D)	19,489円	

* 期首における元本額は38,848,551,378円、当期中における追加設定元本額は5,066,388,246円、同解約元本額は3,375,508,519円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国株式インデックスV A 725,982,741円、ダイワ国内重視バランスファンド3 0 V A（一般投資家私募）32,240,774円、ダイワ国内重視バランスファンド5 0 V A（一般投資家私募）463,206,991円、ダイワ国際分散バランスファンド3 0 V A（一般投資家私募）50,975,833円、ダイワ国際分散バランスファンド5 0 V A（一般投資家私募）1,543,587,080円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）88,958,951円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）147,732,667円、D－I’s 外国株式インデックス1,957,148円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 182,021円、iFree 外国株式インデックス184,046,036円、iFree 8資産バランス31,235,406円、DCダイワ外国株式インデックス22,444,872,014円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 550,340,778円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 735,584,538円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 553,544,620円、大和DC海外株式インデックスファンド1,470,526,931円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 7,625,022円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 15,729,186円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 3,621,406円、ダイワ世界分散バランスファンド1 5 V A 100,000円、ダイワ世界分散バランスファンド2 0 V A 197,107円、ダイワ世界分散バランスファンド2 5 V A 19,292,523円、ダイワ世界分散バランスファンド3 0 V A 163,931,206円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A 1,955,664,069円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 519,301,921円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 5,011,815,577円、ダイワ・バランスファンド2 5 V A（適格機関投資家専用）231,056,464円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式399,881,832円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド17,952,452円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス3,006,649,223円、ダイワライフスタイル2 5 23,902,625円、ダイワライフスタイル5 0 78,118,426円、ダイワライフスタイル7 5 59,617,537円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,489円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月1日 至2016年11月30日

項 目	当 期	
	当	期
(A) 配当等収益	1,735,622,631円	
受取配当金	1,733,407,040	
受取利息	620,632	
その他収益金	1,828,778	
支払利息	△ 233,819	
(B) 有価証券売買損益	△ 5,593,027,175	
売買益	6,250,559,303	
売買損	△ 11,843,586,478	
(C) 先物取引等損益	84,540,402	
取引益	133,979,683	
取引損	△ 49,439,281	
(D) その他費用	△ 45,670,039	
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	△ 3,818,534,181	
(F) 前期繰越損益金	41,029,358,109	
(G) 解約差損益金	△ 2,818,377,481	
(H) 追加信託差損益金	4,074,175,918	
(I) 合計(E + F + G + H)	38,466,622,365	
次期繰越損益金(I)	38,466,622,365	

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

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

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第17期（決算日 2016年11月30日）

（計算期間 2015年12月1日～2016年11月30日）

外国債券インデックスマザーファンドの第17期にかかる運用状況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。
株 式 組 入 制 限	純資産総額の30%以下

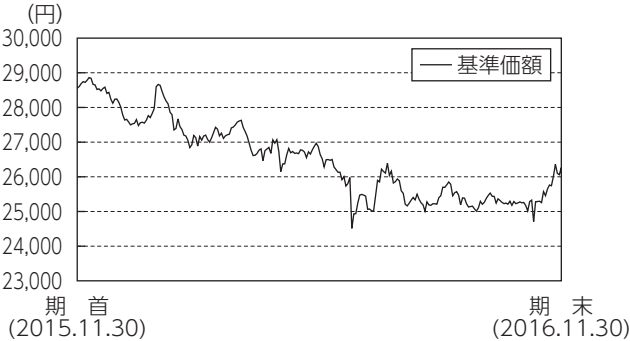
大和投資信託

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
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首)2015年11月30日	28,558	—	28,825	—	98.3	—
12月末	28,152	△ 1.4	28,344	△ 1.7	97.9	—
2016年 1 月末	28,599	0.1	28,342	△ 1.7	98.4	—
2 月末	27,127	△ 5.0	27,450	△ 4.8	98.6	—
3 月末	27,610	△ 3.3	27,848	△ 3.4	97.2	—
4 月末	26,734	△ 6.4	27,341	△ 5.1	97.9	—
5 月末	26,968	△ 5.6	27,251	△ 5.5	97.5	—
6 月末	25,473	△10.8	25,637	△11.1	97.8	—
7 月末	25,888	△ 9.3	26,231	△ 9.0	97.8	—
8 月末	25,699	△10.0	25,857	△10.3	97.6	—
9 月末	25,208	△11.7	25,609	△11.2	98.0	—
10月末	25,250	△11.6	25,581	△11.3	97.9	—
(期末)2016年11月30日	26,265	△ 8.0	26,597	△ 7.7	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) の原データに基づき、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。
(注4) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。
(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：28,558円 期末：26,265円 騰落率：△8.0%

【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、欧州市場で金利が低下 (債券価格は上昇) したものの、米ドルやユーロ等の対円為替レートの下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外債券市況

海外債券市況は、2016年の年明け以降、原油価格や中国・人民元の下落を背景に株式市場の調整が強まったことや、1月末に日銀が予想外のマイナス金利を導入した影響もあり、金利は大きく低下しました。2月中旬から5月ごろにかけては、金利は上下動しながらもおおむねレンジ内での動きにとどまりました。その後、米国の早期利上げ観測が後退したことや、英国のEU (欧州連合) 離脱を問う国民投票でEU離脱派が勝利し市場のリスク回避姿勢が強まったことから、金利低下圧力が強まりました。7月に各国金利は反発し上昇しましたが、8月にはBOE (イングランド銀行) から市場予想以上の金融緩和策が発表され、英国国債金利は低下しました。9月以降は、ECB (欧州中央銀行) の資産買い入れの減額観測が出たことやBOEの追加緩和観測が後退したことなどを受けて、金利は上昇しました。また、11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利し今後の財政拡大などが意識されたことも、さらなる金利上昇の要因となりました。

○為替相場

為替相場は、2016年の年明け以降、リスク回避傾向が強まり円高で推移しました。3月には、原油価格が底打ちの様相となってオーストラリア・ドルやカナダ・ドルなどの資源国通貨が買い戻されました。4月以降は、日銀の主要な金融政策において追加緩和が見送られたことなどから、再び円高が進行しました。その後は、米国の早期利上げ観測の後退や英国の国民投票の結果を受けたリスク回避姿勢の動きから、さらに円高傾向での推移となりました。7月に入るといったんは円安となりましたが、日銀の金融政策決定会合で政策金利が据え置かれたことが市場の失望を誘い、再び円高が進行しました。10月には、原油価格が上昇したことや欧州の一部の銀行に対する経営不安が和らいだことなどを受けて円安になりました。11月は米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したこと で金利が上昇し、大きく円安が進みました。

◆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

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。

◆ベンチマークとの差異について

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0.12%程度でした。ただし、これはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。

《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 (保管費用)	7 (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は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況
公 社 債

(2015年12月 1 日から2016年11月30日まで)

			買 付 額	売 付 額
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 166,210	千アメリカ・ドル 128,162 (—)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 12,460	千カナダ・ドル 10,154 (—)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 9,620	千オーストラリア・ドル 3,697 (—)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,829	千シンガポール・ドル 1,388 (—)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 8,434	千イギリス・ポンド 6,828 (—)
	スイス	国債証券	千スイス・フラン 5,245	千スイス・フラン 5,834 (—)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 12,826	千デンマーク・クローネ 9,788 (—)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 7,367	千ノルウェー・クローネ 7,757 (—)
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローネ 12,632	千スウェーデン・クローネ 9,024 (—)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 46,902	千メキシコ・ペソ 29,821 (—)
国	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 6,494	千マレーシア・リンギット 4,204 (—)

			買 付 額	売 付 額
外	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 15,233	千南アフリカ・ランド 6,998 (—)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 12,686	千ポーランド・ズロチ 7,040 (—)
	ユーロ (アイルランド)	国債証券	千ユーロ 1,537	千ユーロ 1,220 (—)
	ユーロ (オランダ)	国債証券	千ユーロ 4,342	千ユーロ 4,746 (—)
	ユーロ (ベルギー)	国債証券	千ユーロ 4,187	千ユーロ 2,725 (—)
	ユーロ (フランス)	国債証券	千ユーロ 23,410	千ユーロ 15,155 (—)
	ユーロ (ドイツ)	国債証券	千ユーロ 15,457	千ユーロ 13,726 (—)
	ユーロ (スペイン)	国債証券	千ユーロ 11,481	千ユーロ 7,816 (—)
	ユーロ (イタリア)	国債証券	千ユーロ 20,618	千ユーロ 14,350 (—)
	ユーロ (フィンランド)	国債証券	千ユーロ 1,494	千ユーロ 1,047 (—)
国	ユーロ (オーストリア)	国債証券	千ユーロ 2,880	千ユーロ 2,321 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	国債証券	千ユーロ 85,409	千ユーロ 63,110 (—)

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

外国債券インデックスマザーファンド

■主要な売買銘柄
公 社 債

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

当			期		
買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2025/11/15	698,402	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.625% 2017/8/31	671,971
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.625% 2026/2/15	588,498	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.5% 2017/7/31	595,378
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.5% 2026/8/15	578,928	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.625% 2017/9/30	558,858
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.625% 2026/5/15	572,631	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	3.25% 2017/3/31	523,677
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	3% 2045/11/15	446,533	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.75% 2016/11/30	510,352
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.75% 2018/4/30	441,508	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	3.75% 2017/4/25	429,805
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.875% 2018/5/31	411,635	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1% 2017/3/31	429,375
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2046/8/15	409,239	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.875% 2016/12/31	410,988
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.125% 2021/8/31	373,234	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.75% 2017/6/30	403,601
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.125% 2021/7/31	373,051	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	4.25% 2017/10/25	394,944

(注1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国 (外貨建) 公社債 (通貨別)

作 成 期		当		期		未	
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 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
		千円	千円	%	%	%	%
アメリカ	千アメリカ・ドル 590,540	千アメリカ・ドル 599,940	67,445,295	43.5	—	17.6	17.7
カナダ	千カナダ・ドル 34,684	千カナダ・ドル 38,441	3,216,825	2.1	—	1.0	0.6
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 34,514	千オーストラリア・ドル 37,263	3,135,370	2.0	—	1.3	0.6
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,037	千シンガポール・ドル 7,286	575,419	0.4	—	0.2	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 62,812	千イギリス・ポンド 78,823	11,071,541	7.1	—	5.1	1.6
スイス	千スイス・フラン 2,792	千スイス・フラン 3,304	367,180	0.2	—	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 51,791	千デンマーク・クローネ 65,733	1,057,649	0.7	—	0.4	0.2
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 28,227	千ノルウェー・クローネ 30,237	398,524	0.3	—	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 47,400	千スウェーデン・クローネ 55,521	680,141	0.4	—	0.3	0.2
メキシコ	千メキシコ・ペソ 219,416	千メキシコ・ペソ 225,977	1,231,577	0.8	—	0.4	0.3
マレーシア	千マレーシア・リンギット 27,216	千マレーシア・リンギット 26,495	667,167	0.4	—	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 104,423	千南アフリカ・ランド 94,587	766,157	0.5	—	0.4	0.1
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 31,114	千ポーランド・ズロチ 31,602	852,954	0.6	—	0.2	0.3
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 8,336	千ユーロ 9,775	1,170,103	0.8	—	0.4	0.3
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 25,028	千ユーロ 30,098	3,602,804	2.3	—	1.4	0.5
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 25,843	千ユーロ 32,303	3,866,730	2.5	—	1.8	0.5
ユーロ (フランス)	千ユーロ 104,489	千ユーロ 125,253	14,992,864	9.7	—	6.0	2.8
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 78,396	千ユーロ 94,031	11,255,580	7.3	—	4.2	2.2
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 59,673	千ユーロ 69,975	8,376,016	5.4	—	3.3	1.5
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 105,758	千ユーロ 121,214	14,509,366	9.4	—	5.6	2.9
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 6,718	千ユーロ 7,626	912,887	0.6	—	0.4	0.2

区 分	額 面 金 額	期 末				期 末			
		評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		5 年 以 上	2 年 以 上
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上		
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 15,749	千ユーロ 19,264	千円 2,305,937	% 1.5	% -	% 0.9	% 0.4	% 0.1	% 0.1
ユーロ (小計)	429,990	509,542	60,992,290	39.4	-	24.1	11.3	4.0	4.0
合 計	-	-	152,458,096	98.4	-	51.4	33.2	13.8	13.8

(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。

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	期 末		償 還 年 月 日
					評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.2500	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	2017/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.5000	1,686	1,740	195,662	2018/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.8750	3,839	3,957	444,847	2018/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.0000	2,960	3,084	346,709	2018/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.7500	3,173	3,333	374,808	2018/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	2,488	2,615	294,024	2019/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	3,161	3,270	367,630	2019/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.6250	3,096	3,238	364,038	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.3750	2,621	2,784	313,021	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.6250	4,020	4,256	478,461	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.5000	4,280	4,573	514,198	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	3,073	3,278	368,568	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	2,960	2,960	332,827	2017/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	2,372	2,394	269,190	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	4,509	4,679	526,027	2017/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	883	895	100,634	2017/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	924	941	105,884	2018/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.6250	255	259	29,224	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	4,076	4,397	494,377	2018/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	1,234	1,261	141,836	2018/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	1,300	1,332	149,827	2018/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	260	266	29,906	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	2,551	2,702	303,763	2018/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	1,322	1,349	151,665	2018/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	1,065	1,088	122,313	2018/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	1,341	1,368	153,833	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,534	2,570	288,954	2018/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	3,444	3,469	390,078	2018/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,835	2,849	320,377	2018/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	1,320	1,336	150,237	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,153	2,169	243,911	2018/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,165	2,176	244,691	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	1,861	1,870	210,316	2019/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	1,426	1,429	160,673	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	3,224	3,244	364,790	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	1,843	1,851	208,176	2019/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	300	302	33,974	2019/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	559	559	62,913	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	2,459	2,436	273,955	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,385	2,378	267,440	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	1,368	1,359	152,810	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	1,784	1,765	198,471	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,543	2,497	280,723	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	1,872	1,856	208,756	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,215	2,195	246,831	2017/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	2,648	2,646	297,488	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	884	882	99,165	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	3,168	3,099	348,464	2017/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,336	2,330	262,016	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	1,353	1,338	150,522	2017/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	1,913	1,910	214,739	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	1,894	1,879	211,258	2018/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,153	2,151	241,916	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	1,366	1,364	153,415	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	3,850	3,840	431,765	2018/02/28

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	当 期	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 償 還 金 額		償 還 年 月 日
						評 価 額	評 価 額	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	1,968	1,956	219,979	2020/02/29
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,315	2,308	259,518	2018/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	1,160	1,147	128,994	2020/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	4,685	4,591	516,153	2023/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	4,218	4,196	471,778	2018/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	1,451	1,433	161,196	2020/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	3,407	3,407	383,041	2018/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,461	2,449	275,390	2020/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	1,693	1,702	191,389	2018/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	2,131	2,156	242,458	2020/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,827	2,870	322,724	2020/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	1,697	1,706	191,848	2018/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	3,768	3,863	434,285	2023/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	1,993	2,031	228,375	2020/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	1,885	1,912	215,022	2020/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	3,611	3,622	407,215	2018/10/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,345	2,356	264,900	2020/10/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	5,021	5,228	587,784	2023/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	2,638	2,645	297,453	2018/11/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,501	2,534	284,873	2020/11/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,026	2,042	229,575	2018/12/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	2,006	2,062	231,855	2020/12/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	5,229	5,443	611,998	2024/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,185	2,201	247,516	2019/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	1,647	1,676	188,453	2021/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,373	2,390	268,773	2019/02/28
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	1,734	1,754	197,281	2021/02/28
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,383	2,407	270,637	2019/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,821	2,882	324,072	2021/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	5,412	5,536	622,434	2024/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,975	3,004	337,793	2019/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,407	2,459	276,512	2021/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,241	2,256	253,643	2019/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,732	2,761	310,463	2021/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,885	2,912	327,422	2019/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	3,485	3,540	397,993	2021/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	8.8750	904	1,058	119,023	2019/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	8.1250	724	855	96,178	2019/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	8.7500	642	808	90,893	2020/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	8.0000	2,106	2,721	305,896	2021/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.2500	654	825	92,827	2023/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.0000	855	1,119	125,892	2026/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.5000	630	865	97,256	2026/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.1250	709	965	108,499	2027/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.5000	700	919	103,340	2028/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.2500	738	953	107,142	2028/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.2500	473	613	68,923	2029/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.2500	964	1,382	155,413	2030/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.3750	1,241	1,676	188,451	2031/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.5000	1,926	2,477	278,465	2036/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.0000	547	747	84,029	2037/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	548	693	77,969	2038/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.5000	1,019	1,310	147,364	2038/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.5000	849	947	106,495	2039/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.2500	1,121	1,388	156,041	2039/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.5000	760	971	109,261	2039/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	1,210	1,522	171,150	2039/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.6250	1,710	2,227	250,374	2040/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	1,478	1,860	209,174	2040/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.8750	1,591	1,862	209,418	2040/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.2500	1,469	1,815	204,120	2040/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.7500	1,754	2,328	261,715	2041/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	1,365	1,720	193,411	2041/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.7500	1,367	1,569	176,405	2041/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	1,450	1,500	168,675	2041/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	1,623	1,680	188,871	2042/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	1,853	1,875	210,803	2042/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	1,731	1,672	188,015	2042/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	3,030	2,922	328,574	2042/11/15

区 分	当 期	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 償 還 金 額		償 還 年 月 日
						評 価 額	償 還 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	3.1250	2,026	2,097	235,805	2043/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,998	3,943	443,306	2043/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,314	3,756	422,300	2043/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	3,581	4,149	466,452	2043/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,617	4,098	460,785	2044/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,357	3,635	408,732	2044/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,326	3,356	377,296	2019/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,891	325,094	2021/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,662	5,734	644,624	2024/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,729	3,856	433,589	2044/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,989	3,015	339,000	2019/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,312	147,497	2021/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,404	3,445	387,308	2019/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,675	413,219	2021/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,190	3,204	360,244	2019/10/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,179	244,988	2021/10/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,932	666,883	2024/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,696	3,731	419,464	2044/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,593	1,593	179,119	2017/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,890	324,937	2021/11/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,325	4,342	488,132	2019/11/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,517	1,518	170,759	2017/12/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,210	360,876	2021/12/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,204	2,220	249,572	2019/12/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,547	1,546	173,838	2018/01/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,963	3,942	443,257	2020/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,427	2,382	267,853	2022/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,635	633,522	2025/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,763	3,424	384,992	2045/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,961	1,962	220,636	2018/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,788	2,781	312,690	2020/02/29
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,809	1,796	201,921	2022/02/28
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,081	2,082	234,100	2018/03/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,792	2,784	312,991	2020/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,083	2,076	233,428	2018/04/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,867	322,363	2022/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,180	2,180	245,102	2018/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,723	643,464	2025/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,035	4,065	457,016	2045/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,607	2,597	291,956	2020/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,588	291,001	2022/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,816	316,631	2022/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,013	3,010	338,453	2020/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,196	2,199	247,286	2018/06/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,001	3,009	338,320	2020/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,847	320,083	2022/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,189	2,183	245,518	2018/07/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,135	3,140	353,067	2020/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,182	245,401	2022/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,143	6,005	675,105	2025/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,573	3,510	394,615	2045/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	14	13	1,572	2018/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,431	273,363	2022/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,868	2,844	319,825	2020/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,179	2,176	244,627	2018/09/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,439	274,231	2022/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,876	2,850	320,413	2020/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,057	2,049	230,387	2018/10/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,820	654,326	2025/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,116	3,085	346,906	2020/10/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	3,734	419,830	2045/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,540	285,568	2022/10/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,138	2,144	241,075	2018/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,277	2,277	256,028	2017/11/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,092	347,617	2020/11/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,687	2,684	301,833	2022/11/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,151	2,156	242,465	2018/12/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	3,051	343,082	2020/12/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,276	2,278	256,177	2017/12/31

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 償 還 金 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	千アメリカ・ドル 2,492	千アメリカ・ドル 2,505	千円 281,638	2022/12/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	2,146	2,145	241,185	2019/01/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	3,126	3,085	346,891	2021/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	5,366	5,062	569,071	2026/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,329	2,324	261,281	2018/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,065	2,047	230,160	2019/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,561	2,518	283,093	2023/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	3,428	3,110	349,728	2046/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,100	2,092	235,203	2019/03/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	3,309	3,230	363,133	2021/02/28
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,262	2,188	246,029	2023/02/28
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	3,002	2,942	330,785	2021/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	700	699	78,604	2018/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,123	2,051	230,667	2023/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	1,125	1,116	125,558	2019/04/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	5,529	5,207	585,388	2026/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,450	2,412	271,168	2021/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	4,300	4,286	481,834	2018/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,070	2,014	226,454	2023/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	3,423	3,106	349,187	2046/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	2,507	2,486	279,511	2019/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	4,000	3,992	448,888	2018/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,700	2,657	298,765	2021/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,500	2,430	273,208	2023/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	2,100	2,081	233,969	2019/06/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	1,000	993	111,738	2018/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	2,500	2,429	273,121	2021/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	3,000	2,868	322,504	2023/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,500	2,466	277,303	2019/07/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	5,600	5,203	584,941	2026/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	3,480	2,987	335,805	2046/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,500	2,463	276,997	2019/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,200	2,188	245,981	2018/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	3,700	3,589	403,571	2021/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	1,770	1,761	198,026	2018/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	3,700	3,591	403,733	2021/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	2,780	2,634	296,166	2023/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,400	2,291	257,558	2023/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	2,600	2,569	288,807	2019/09/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	3,000	2,982	335,243	2018/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,505	2,389	268,652	2023/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	3,042	2,946	331,294	2021/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,147	2,126	239,072	2019/10/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,326	2,310	259,781	2018/10/31
通貨小計	銘 柄 数 額	237銘柄			590,540	599,940	67,445,294	
カナダ	Canada Government International Bond	国 債 証 券	2.7500	325	千カナダ・ドル 389	千カナダ・ドル 389	32,602	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	8.0000	386	623	623	52,150	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	983	1,419	1,419	118,747	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	1,127	1,722	1,722	144,165	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.0000	1,192	1,768	1,768	147,961	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	969	1,020	1,020	85,417	2018/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	1,524	1,639	1,639	137,169	2019/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,413	1,913	1,913	160,140	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	1,476	1,612	1,612	134,893	2020/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	956	1,053	1,053	88,138	2021/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,351	1,471	1,471	123,152	2022/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	1,491	1,929	1,929	161,493	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,253	1,276	1,276	106,794	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,265	1,274	1,274	106,657	2018/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,021	1,031	1,031	86,307	2018/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,405	1,524	1,524	127,547	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	853	873	873	73,071	2019/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,627	1,671	1,671	139,894	2019/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	847	972	972	81,409	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,156	1,232	1,232	103,104	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	829	847	847	70,905	2020/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,772	1,784	1,784	149,363	2018/02/01

当		期			未																	
区	分	銘	柄	種	年	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日			
												外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額
		CANADIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.7500		千カナダ・ドル	931	千カナダ・ドル	927		千円	77,617						2020/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.5000			1,029		1,027			85,973						2026/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.2500			1,128		1,124			94,083						2017/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.7500			1,237		1,228			102,812						2021/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.2500			1,284		1,276			106,821						2018/05/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.7500			980		970			81,231						2021/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.5000			1,344		1,340			112,143						2018/08/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.0000			390		366			30,662						2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.5000			800		797			66,721						2018/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.5000			340		330			27,671						2022/03/01
通貨小計	銘	柄	数	額							34,684		38,441			3,216,825						
オーストラリア										千オーストラリア・ドル		千オーストラリア・ドル										
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	5.2500			2,455		2,642			222,320						2019/03/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	5.7500			2,420		2,795			235,185						2021/05/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.5000			2,209		2,391			201,240						2020/04/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	5.7500			2,032		2,406			202,494						2022/07/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	5.5000			2,063		2,151			181,056						2018/01/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	5.5000			2,068		2,450			206,174						2023/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.7500			2,589		3,066			258,016						2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.7500			2,173		2,209			185,929						2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	3.2500			1,314		1,362			114,641						2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	3.2500			2,398		2,516			211,714						2025/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.5000			958		1,127			94,871						2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	3.2500			1,197		1,230			103,500						2018/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.2500			2,848		3,224			271,333						2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.7500			1,511		1,547			130,191						2019/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	3.7500			863		914			76,950						2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.7500			557		516			43,458						2035/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.7500			1,495		1,478			124,420						2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	3.2500			412		400			33,659						2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.7500			1,592		1,589			133,719						2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.2500			678		640			53,877						2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	3.0000			682		601			50,611						2047/03/21
通貨小計	銘	柄	数	額							34,514		37,263			3,135,370						
シンガポール										千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル										
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	4.0000			491		515			40,729						2018/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	3.2500			696		740			58,497						2020/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	3.5000			442		485			38,360						2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	3.1250			438		466			36,864						2022/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	2.5000			599		617			48,736						2019/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	3.0000			503		531			41,946						2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	2.8750			359		366			28,948						2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	2.2500			495		507			40,106						2021/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	2.7500			400		402			31,745						2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	0.5000			504		500			39,509						2018/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	2.7500			421		438			34,619						2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	3.3750			238		257			20,354						2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	2.8750			125		128			10,172						2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	1.6250			270		272			21,503						2019/10/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	2.3750			224		225			17,804						2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	2.0000			224		228			18,025						2020/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	2.7500			168		169			13,346						2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	2.1250			250		246			19,449						2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT		国	債	証	券	1.2500			190		186			14,698						2021/10/01
通貨小計	銘	柄	数	額							7,037		7,286			575,419						
イギリス										千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド										
		United Kingdom Gilt		国	債	証	券	2.0000			2,380		2,514			353,215						2020/07/22
		United Kingdom Gilt		国	債	証	券	2.0000			2,121		2,254			316,624						2025/09/07
		United Kingdom Gilt		国	債	証	券	1.5000			2,477		2,572			361,383						2021/01/22
		United Kingdom Gilt		国	債	証	券	2.5000			1,182		1,445			202,997						2065/07/22
		United Kingdom Gilt		国	債	証	券	1.5000			945		955			134,181						2026/07/22
		United Kingdom Gilt		国	債	証	券	0.5000			60		58			8,280						2022/07/22
		United Kingdom Gilt		国	債	証	券	1.5000			400		358			50,352						2047/07/22
		United Kingdom Gilt		国	債	証	券	8.0000			1,102		1,470			206,532						2021/06/07
		United Kingdom Gilt		国	債	証	券	6.0000			949		1,414			198,705						2028/12/07
		United Kingdom Gilt		国	債	証	券	4.2500			1,840		2,455			344,845						2032/06/07

外国債券インデックスマザーファンド

当		期			末																	
区	分	銘	柄	種	類	年	利	率	額	面	金	額	評 価									
													外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	償 還 年 月 日							
									%	千	イ	ギ	リ	ス	・	ポ	ン	ド	千	日	円	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	5.0000		1,472		1,915			269,094							2025/03/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.2500		2,032		2,790			391,988							2026/03/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.7500		1,457		2,179			306,177							2038/12/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.7500		1,724		1,974			277,386							2020/03/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.2500		1,708		2,856			401,266							2055/12/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.2500		1,666		2,512			352,951							2046/12/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.2500		1,232		1,574			221,188							2027/12/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	5.0000		1,604		1,704			239,378							2018/03/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.5000		1,666		2,510			352,647							2042/12/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.7500		1,500		2,073			291,257							2030/12/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.2500		1,373		2,149			301,967							2049/12/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.5000		1,573		1,729			242,971							2019/03/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.2500		1,246		1,758			247,066							2039/09/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.0000		1,232		1,445			203,087							2023/03/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.5000		1,870		2,611			366,831							2034/09/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	3.7500		1,428		1,568			220,373							2019/09/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.0000		1,244		2,061			289,583							2060/01/22	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	3.7500		1,795		2,020			283,792							2020/09/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	4.2500		1,577		2,252			316,420							2040/12/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	3.7500		1,633		1,875			263,478							2021/09/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	3.7500		1,182		1,752			246,196							2052/07/22	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	1.7500		2,242		2,364			332,105							2022/09/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	3.2500		2,156		2,706			380,144							2044/01/22	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	1.2500		2,854		2,908			408,489							2018/07/22	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	2.2500		1,942		2,110			296,422							2023/09/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	3.5000		1,621		2,536			356,236							2068/07/22	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	1.7500		2,161		2,250			316,039							2019/07/22	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	2.7500		1,842		2,068			290,524							2024/09/07	
		United Kingdom Gilt	国	債	証	券	3.5000		2,324		3,056			429,352							2045/01/22	
通貨小計	銘金	柄数	39	銘柄							62,812			78,823			11,071,541					
スイス											千	ス	イ	ス	・	フ	ラ	ン				
		SWISS GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	4.0000		404		517			57,538							2023/02/11	
		SWISS GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	4.0000		497		728			80,987							2028/04/08	
		SWISS GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	3.0000		605		632			70,223							2018/01/08	
		SWISS GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	3.0000		517		567			63,048							2019/05/12	
		SWISS GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	2.2500		407		452			50,280							2020/07/06	
		SWISS GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	2.0000		362		405			45,102							2021/04/28	
通貨小計	銘金	柄数	6	銘柄							2,792			3,304			367,180					
デンマーク											千	デ	ン	マ	ー	ク	・	ク	ロ	ー	ネ	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	7.0000		1,864		2,885			46,427							2024/11/10	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	4.0000		5,291		5,527			88,940							2017/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	4.5000		11,512		20,161			324,391							2039/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	4.0000		8,601		9,762			157,081							2019/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	3.0000		7,650		8,894			143,117							2021/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	1.5000		5,846		6,445			103,712							2023/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	1.7500		7,863		8,841			142,258							2025/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	0.2500		3,164		3,214			51,721							2018/11/15	
通貨小計	銘金	柄数	8	銘柄							51,791			65,733			1,057,649					
ノルウェー											千	ノ	ル	ウ	ェ	ー	・	ク	ロ	ー	ネ	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	4.5000		6,075		6,635			87,459							2019/05/22	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	3.7500		6,698		7,476			98,540							2021/05/25	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	2.0000		4,824		5,022			66,196							2023/05/24	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	3.0000		4,095		4,535			59,780							2024/03/14	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	1.7500		3,395		3,452			45,503							2025/03/13	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	1.5000		3,140		3,114			41,043							2026/02/19	
通貨小計	銘金	柄数	6	銘柄							28,227			30,237			398,524					
スウェーデン											千	ス	ウ	ェ	ー	デ	ン	・	ク	ロ	ー	ネ
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	5.0000		8,095		9,879			121,018							2020/12/01	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	4.2500		8,385		9,345			114,485							2019/03/12	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	3.5000		4,155		5,826			71,369							2039/03/30	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	3.5000		8,165		9,832			120,453							2022/06/01	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	1.5000		7,025		7,734			94,752							2023/11/13	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	2.5000		5,495		6,524			79,921							2025/05/12	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	1.0000		6,080		6,378			78,140							2026/11/12	
通貨小計	銘金	柄数	7	銘柄							47,400			55,521			680,141					

当		期			未		
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価	額	償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
メキシコ	Mexican Bonos	国 債 証 券	5.0000	15,647	14,937	81,411	2019/12/11
	Mexican Bonos	国 債 証 券	5.7500	7,590	6,799	37,055	2026/03/05
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	8,233	8,610	46,926	2023/12/07
	Mexican Bonos	国 債 証 券	10.0000	21,119	24,629	134,232	2024/12/05
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.5000	8,568	8,607	46,912	2027/06/03
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	13,756	13,993	76,263	2017/12/14
	Mexican Bonos	国 債 証 券	10.0000	6,874	8,540	46,543	2036/11/20
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.5000	8,844	9,558	52,094	2029/05/31
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.5000	22,092	22,897	124,793	2018/12/13
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.5000	9,694	10,562	57,565	2038/11/18
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	12,728	13,231	72,112	2020/06/11
	Mexican Bonos	国 債 証 券	6.5000	21,626	21,194	115,508	2021/06/10
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	13,015	13,231	72,109	2031/05/29
	Mexican Bonos	国 債 証 券	6.5000	11,399	11,089	60,436	2022/06/09
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	14,654	14,801	80,666	2042/11/13
	Mexican Bonos	国 債 証 券	4.7500	16,633	16,247	88,549	2018/06/14
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	6,944	7,045	38,396	2034/11/23
通貨小計	銘 柄 数 額	17銘柄		219,416	225,977	1,231,577	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.2400	1,210	1,213	30,560	2018/02/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	5.7340	647	672	16,930	2019/07/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.5020	573	517	13,029	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	5.2480	738	770	19,406	2028/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.3780	1,603	1,611	40,573	2019/11/29
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.4980	1,178	1,140	28,724	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.1600	1,916	1,912	48,150	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.3920	1,514	1,463	36,860	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.2320	420	395	9,953	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.5800	1,595	1,586	39,949	2018/09/28
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.4180	875	829	20,888	2022/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8920	731	678	17,073	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.1270	618	560	14,106	2032/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.3140	599	597	15,052	2017/10/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.4920	1,044	1,017	25,621	2020/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.2600	533	528	13,307	2018/03/01
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.4800	1,001	938	23,638	2023/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8440	477	424	10,700	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.7330	586	530	13,354	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8890	656	645	16,258	2020/07/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.9350	600	587	14,790	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.1810	1,057	1,028	25,898	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.0480	857	850	21,422	2021/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.6540	648	640	16,115	2019/10/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.9550	737	702	17,691	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.6590	700	687	17,315	2020/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.7950	1,161	1,115	28,079	2022/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.2540	620	573	14,429	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.7590	768	765	19,278	2019/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8000	702	682	17,174	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.7360	450	434	10,948	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.9000	50	47	1,202	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.6200	352	344	8,676	2021/11/30
通貨小計	銘 柄 数 額	33銘柄		27,216	26,495	667,167	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	8.0000	4,178	4,179	33,849	2018/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	7.2500	5,768	5,614	45,480	2020/01/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	10.5000	15,434	16,954	137,329	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	6.2500	7,612	5,398	43,731	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	6.7500	6,122	5,756	46,624	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	6.5000	8,904	6,265	50,752	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	7.0000	8,999	7,329	59,365	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	7.7500	4,639	4,429	35,877	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	8.7500	10,852	9,809	79,460	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	8.5000	7,321	6,550	53,055	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	8.0000	7,862	7,048	57,091	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	8.7500	6,044	5,475	44,351	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	8.2500	5,943	5,346	43,302	2032/03/31

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 償 還 金 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券 国 債 証 券	% 8.8750 9.0000	千南アフリカ・ランド 3,166 1,579	千南アフリカ・ランド 2,957 1,472	千円 23,954 11,930	2035/02/28 2040/01/31
通貨小計	銘 柄 数 額 金	15銘柄			104,423	94,587	766,157	
ポーランド		Poland Government Bond	国 債 証 券	5.7500	2,309	2,624	70,841	2022/09/23
		Poland Government Bond	国 債 証 券	5.5000	1,912	2,085	56,275	2019/10/25
		Poland Government Bond	国 債 証 券	1.5000	2,078	2,016	54,428	2020/04/25
		Poland Government Bond	国 債 証 券	2.5000	3,377	3,073	82,956	2026/07/25
		Poland Government Bond	国 債 証 券	2.0000	2,127	2,056	55,512	2021/04/25
		Poland Government Bond	国 債 証 券	—	1,668	1,609	43,439	2018/10/25
		Poland Government Bond	国 債 証 券	1.7500	3,051	2,905	78,429	2021/07/25
		Poland Government Bond	国 債 証 券	5.7500	627	748	20,198	2029/04/25
		Poland Government Bond	国 債 証 券	5.2500	2,256	2,478	66,885	2020/10/25
		Poland Government Bond	国 債 証 券	5.7500	884	998	26,941	2021/10/25
		Poland Government Bond	国 債 証 券	4.0000	2,575	2,681	72,368	2023/10/25
		Poland Government Bond	国 債 証 券	3.7500	1,720	1,767	47,703	2018/04/25
		Poland Government Bond	国 債 証 券	2.5000	2,099	2,124	57,341	2018/07/25
		Poland Government Bond	国 債 証 券	3.2500	1,840	1,893	51,111	2019/07/25
	Poland Government Bond	国 債 証 券	3.2500	2,591	2,538	68,520	2025/07/25	
通貨小計	銘 柄 数 額 金	15銘柄			31,114	31,602	852,954	
ユーロ (アイルランド)		IRISH TREASURY	国 債 証 券	4.5000	759	831	99,506	2018/10/18
		IRISH TREASURY	国 債 証 券	4.4000	684	769	92,122	2019/06/18
		IRISH TREASURY	国 債 証 券	5.9000	570	674	80,755	2019/10/18
		IRISH TREASURY	国 債 証 券	5.4000	1,131	1,561	186,887	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国 債 証 券	5.0000	765	923	110,512	2020/10/18
		IRISH TREASURY	国 債 証 券	3.9000	504	620	74,279	2023/03/20
		IRISH TREASURY	国 債 証 券	3.4000	607	734	87,889	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国 債 証 券	2.4000	761	874	104,695	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国 債 証 券	0.8000	516	539	64,526	2022/03/15
		IRISH TREASURY	国 債 証 券	2.0000	531	562	67,334	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.0000	473	479	57,348	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	4.5000	1,035	1,205	144,243	2020/04/18	
国 小 計	銘 柄 数 額 金	12銘柄			8,336	9,775	1,170,103	
ユーロ (オランダ)		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	7.5000	548	810	97,025	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	1,239	1,918	229,702	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,355	2,168	259,569	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	791	986	118,036	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,544	1,663	199,097	2018/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,347	1,514	181,301	2019/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	1,146	1,318	157,806	2020/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	1,349	2,224	266,240	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,463	1,716	205,481	2021/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,438	1,646	197,104	2022/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,168	1,487	178,061	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,477	1,510	180,838	2018/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,385	1,558	186,595	2023/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	924	962	115,270	2019/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,004	1,468	175,726	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	1,514	1,736	207,914	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,374	1,412	169,115	2020/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,323	1,336	159,954	2018/04/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,291	1,291	154,596	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	948	958	114,682	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	400	406	48,681	2022/01/15	
国 小 計	銘 柄 数 額 金	21銘柄			25,028	30,098	3,602,804	
ユーロ (ベルギー)		Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.8000	1,399	1,444	172,899	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.0000	924	927	111,056	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.9000	558	630	75,434	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.0000	1,283	1,331	159,360	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.6000	544	557	66,725	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	2.1500	290	327	39,204	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.2000	150	151	18,138	2023/10/22

当 区 分		銘 柄	種 類	期		未		償 還 年 月 日
				年 利 率	額 面 金 額	評 価	額	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	5.5000	1,706	千ユーロ	千円	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	5.0000	1,704	2,611	312,540	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.0000	1,377	2,839	339,911	2022/03/28
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.0000	966	1,694	202,799	2018/03/28
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.0000	1,121	1,026	122,885	2019/03/28
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	3.7500	1,736	2,018	241,660	2020/09/28
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.2500	1,474	2,397	287,013	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.2500	1,446	1,768	211,672	2021/09/28
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.5000	801	1,099	131,659	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.2500	1,316	1,659	198,647	2022/09/28
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.0000	680	977	117,036	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	3.0000	1,123	1,236	148,064	2019/09/28
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	2.2500	1,338	1,543	184,699	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.2500	1,052	1,083	129,742	2018/06/22
		Belgium Government Bond	国 債 証 券	3.7500	753	1,170	140,111	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	2.6000	1,505	1,777	212,784	2024/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	3.0000	597	785	93,976	2034/06/22	
国 小 計	銘 柄 数 額	24銘柄			25,843	32,303	3,866,730	
ユーロ (フランス)		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	8.5000	653	千ユーロ	千円	2019/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	8.5000	685	826	98,910	2023/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.0000	2,225	1,056	126,519	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	2,623	3,302	395,282	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	2,507	4,066	486,746	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	2,709	4,227	506,029	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	3,075	4,305	515,370	2019/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,564	3,438	411,565	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	3,230	2,612	312,730	2021/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	2,424	3,809	456,050	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	3,697	3,663	438,478	2023/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	2,931	4,754	569,112	2018/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	2,567	3,125	374,083	2018/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	2,484	2,809	336,319	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	3,263	4,076	487,923	2019/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	3,380	3,674	439,891	2020/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,017	3,837	459,403	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	3,146	1,746	209,039	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	3,113	3,981	476,617	2020/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	3,550	3,466	414,893	2021/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	3,480	4,158	497,726	2022/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	3,099	4,077	488,057	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	2,694	3,735	447,199	2022/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	2,114	3,063	366,724	2018/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	2,088	2,167	259,473	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	3,347	2,917	349,277	2023/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	1,920	3,712	444,401	2018/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	3,086	1,983	237,463	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	1,764	3,549	424,891	2019/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	2,787	1,836	219,776	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	2,799	3,332	398,856	2024/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,322	3,110	372,293	2019/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,792	2,394	286,576	2025/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	-	3,070	2,803	335,612	2020/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	-	1,335	3,117	373,127	2018/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	2,101	1,346	161,223	2025/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	2,193	2,181	261,151	2020/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	2,020	2,244	268,718	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	-	1,592	2,145	256,831	2019/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,737	1,614	193,295	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	879	2,700	323,196	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	257	871	104,333	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	-	2,170	255	30,571	2021/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,000	2,194	262,660	2026/11/25	
国 小 計	銘 柄 数 額	44銘柄			104,489	125,253	14,992,864	
ユーロ (ドイツ)		GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.2500	774	千ユーロ	千円	2024/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.5000	1,067	1,129	135,222	2027/07/04

外国債券インデックスマザーファンド

当		期										未																																									
区		銘		柄		種		類		年		利		率		額		面		金		額		評		価		額		償		還		年		月		日															
分																								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		%		千		ユ		ー		ロ		2,157		2,157		258,272		2028/01/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		4.7500				千		ユ		ー		ロ		1,426		1,426		170,712		2028/07/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		6.2500				千		ユ		ー		ロ		1,663		1,663		199,076		2030/01/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		5.5000				千		ユ		ー		ロ		2,443		2,443		292,507		2031/01/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		4.7500				千		ユ		ー		ロ		3,009		3,009		360,213		2034/07/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		4.0000				千		ユ		ー		ロ		3,364		3,364		402,736		2037/01/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		4.2500				千		ユ		ー		ロ		2,120		2,120		253,870		2039/07/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		4.0000				千		ユ		ー		ロ		1,894		1,894		226,743		2018/01/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		4.2500				千		ユ		ー		ロ		2,390		2,390		286,093		2018/07/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		4.7500				千		ユ		ー		ロ		2,605		2,605		311,896		2040/07/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		3.7500				千		ユ		ー		ロ		2,938		2,938		351,793		2019/01/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		3.5000				千		ユ		ー		ロ		2,757		2,757		330,079		2019/07/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		3.2500				千		ユ		ー		ロ		2,331		2,331		279,106		2020/01/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		3.0000				千		ユ		ー		ロ		2,183		2,183		261,380		2020/07/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		3.2500				千		ユ		ー		ロ		2,146		2,146		256,990		2042/07/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		2.2500				千		ユ		ー		ロ		1,603		1,603		191,955		2020/09/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		2.5000				千		ユ		ー		ロ		2,631		2,631		315,047		2021/01/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		3.2500				千		ユ		ー		ロ		1,968		1,968		235,598		2021/07/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		2.2500				千		ユ		ー		ロ		1,602		1,602		191,824		2021/09/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		2.0000				千		ユ		ー		ロ		1,921		1,921		229,954		2022/01/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		1.7500				千		ユ		ー		ロ		2,489		2,489		297,962		2022/07/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		2.5000				千		ユ		ー		ロ		2,429		2,429		290,806		2044/07/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		1.5000				千		ユ		ー		ロ		1,821		1,821		218,045		2022/09/04																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		1.5000				千		ユ		ー		ロ		1,568		1,568		187,757		2023/02/15																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		1.5000				千		ユ		ー		ロ		2,025		2,025		242,474		2023/05/15																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		2.0000				千		ユ		ー		ロ		1,839		1,839		220,200		2023/08/15																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		1.7500				千		ユ		ー		ロ		1,778		1,778		212,917		2024/02/15																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		2.5000				千		ユ		ー		ロ		2,431		2,431		291,001		2046/08/15																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		1.5000				千		ユ		ー		ロ		1,789		1,789		214,251		2024/05/15																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		1.0000				千		ユ		ー		ロ		1,673		1,673		200,316		2024/08/15																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		0.5000				千		ユ		ー		ロ		2,497		2,497		298,989		2025/02/15																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		1.0000				千		ユ		ー		ロ		2,200		2,200		263,424		2025/08/15																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		0.5000				千		ユ		ー		ロ		2,238		2,238		267,941		2026/02/15																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		-				千		ユ		ー		ロ		1,663		1,663		199,086		2026/08/15																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		733				千		ユ		ー		ロ		739		739		88,501		2017/12/15																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		747				千		ユ		ー		ロ		754		754		90,354		2018/03/16																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		-				千		ユ		ー		ロ		1,518		1,518		181,740		2018/06/15																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		709				千		ユ		ー		ロ		709		709		84,957		2018/09/14																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		0.5000				千		ユ		ー		ロ		1,209		1,209		144,771		2018/02/23																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		0.2500				千		ユ		ー		ロ		1,412		1,412		169,023		2018/04/13																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		1.0000				千		ユ		ー		ロ		1,249		1,249		149,578		2018/10/12																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		1.0000				千		ユ		ー		ロ		1,495		1,495		178,962		2019/02/22																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		0.5000				千		ユ		ー		ロ		1,146		1,146		137,245		2019/04/12																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		0.2500				千		ユ		ー		ロ		1,183		1,183		141,679		2019/10/11																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		-				千		ユ		ー		ロ		1,731		1,731		211,972		2020/04/17																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		0.2500				千		ユ		ー		ロ		1,496		1,496		179,177		2020/10/16																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		-				千		ユ		ー		ロ		1,615		1,615		193,319		2021/04/09																			
		GERMAN		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		-				千		ユ		ー		ロ		1,227		1,227		146,873		2021/10/08																			
国小計		銘柄数額		50銘柄																				78,396		94,031		11,255,580																									
ユーロ (スペイン)		SPANISH		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		6.0000		千		ユ		ー		ロ		2,677		2,677		320,460		2029/01/31																					
		SPANISH		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		0.5000				千		ユ		ー		ロ		1,746		1,746		209,097		2017/10/31																			
		SPANISH		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		1.6000				千		ユ		ー		ロ		1,779		1,779		212,989		2025/04/30																			
		SPANISH		GOVERNMENT		BOND		国		債		証		券		1.9500				千		ユ		ー		ロ		1,556		1,556		186,368		2030/07/30																			
		SPANISH		GOVERNMENT		BOND		国		債		証																																									

当		期				未																		
区	分	銘	柄	種	類	年	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日				
													外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.6000	%	千ユーロ	2,382		千ユーロ	2,659		千円	318,348							2019/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.3000			1,775			1,985			237,613						2019/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.7000			1,173			1,630			195,129						2041/07/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.0000			2,101			2,365			283,127						2020/04/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.6500			1,789			2,264			271,009						2025/07/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.8500			1,681			1,973			236,172						2020/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	5.5000			2,515			3,066			367,061						2021/04/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	5.9000			1,265			1,761			210,907						2026/07/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	5.8500			1,978			2,499			299,173						2022/01/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.5000			2,000			2,108			252,387						2018/01/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	5.4000			2,158			2,747			328,826						2023/01/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.4000			1,601			1,961			234,766						2023/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	5.1500			1,270			1,732			207,323						2028/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	3.7500			1,564			1,677			200,796						2018/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	5.1500			1,049			1,558			186,502						2044/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.7500			1,836			1,951			233,588						2019/04/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	3.8000			1,970			2,335			279,565						2024/04/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.7500			2,097			2,330			278,981						2024/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.4000			1,900			1,968			235,587						2020/01/31	
国	小	計	銘	柄	数	額					59,673			69,975			8,376,016							
ユーロ	(イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	9.0000		千ユーロ	1,106		千ユーロ	1,658			198,464						2023/11/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	7.2500			510			755			90,433						2026/11/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	6.5000			2,392			3,431			410,709						2027/11/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.5000			1,814			1,925			230,496						2024/12/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.7500			1,376			1,388			166,245						2018/01/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.0500			1,445			1,470			176,066						2019/12/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	3.2500			1,129			1,188			142,320						2046/09/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.3500			1,229			1,246			149,192						2022/04/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.5000			1,687			1,654			198,097						2025/06/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.6500			1,465			1,345			161,084						2032/03/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.2500			1,258			1,261			150,968						2018/05/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.7000			1,511			1,519			181,890						2020/05/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.0000			1,591			1,611			192,943						2025/12/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.4500			1,504			1,529			183,028						2022/09/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.3000			371			371			44,503						2018/10/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.6500			774			775			92,781						2020/11/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.7000			1,140			1,074			128,617						2047/03/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.9500			1,259			1,234			147,777						2023/03/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.6000			1,286			1,254			150,168						2026/06/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.1000			812			807			96,622						2019/04/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.4500			1,674			1,648			197,380						2021/06/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.2500			924			878			105,198						2036/09/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.2500			1,218			1,141			136,610						2026/12/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.6500			700			664			79,595						2023/10/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.3500			358			348			41,666						2021/11/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.8000			448			390			46,755						2067/03/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.0500			358			354			42,401						2019/10/15	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	5.2500			2,654			3,559			426,023						2029/11/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	6.0000			2,849			4,127			494,080						2031/05/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	5.7500			1,455			2,089			250,133						2033/02/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	4.2500			2,074			2,250			269,409						2019/02/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	4.5000			1,921			2,161			258,787						2020/02/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	5.0000			2,098			2,829			338,657						2034/08/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	4.0000			2,390			2,878			344,515						2037/02/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	3.7500			2,734			3,098			370,873						2021/08/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	4.5000			2,480			2,610			312,482						2018/02/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	5.0000			1,734			2,355			281,901						2039/08/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	4.7500			2,101			2,559			306,384						2023/08/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	4.5000			2,187			2,346			280,831						2018/08/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	4.5000			2,708			2,961			354,516						2019/03/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	4.2500			2,531			2,796			334,726						2019/09/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	5.0000			2,118			2,654			317,706						2025/03/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	5.0000			1,893			2,561			306,665						2040/09/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	4.2500			2,560			2,869			343,433						2020/03/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	4.0000			2,214			2,493			298,444						2020/09/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	4.5000			2,070			2,527			302,580						2026/03/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国	債	証	券	3.7500			2,144			2,415			289,106						2021/03/01	

外国債券インデックスマザーファンド

当		期										末			
区	分	銘	柄	種	類	年	利	率	額	面	金	額	評 価		
													外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	償 還 年 月 日
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		%			千ユーロ	千ユーロ	千円		
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		4.7500			2,281	2,692	322,321	2021/09/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		5.0000			2,012	2,418	289,540	2022/03/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		5.5000			1,657	2,059	246,567	2022/09/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		5.5000			1,910	2,376	284,457	2022/11/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		3.5000			1,295	1,338	160,241	2017/11/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		4.7500			1,810	2,302	275,639	2028/09/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		4.5000			1,594	1,905	228,092	2023/05/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		3.5000			1,770	1,861	222,820	2018/06/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		4.7500			1,363	1,805	216,175	2044/09/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		4.5000			2,194	2,638	315,836	2024/03/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		3.5000			2,111	2,248	269,111	2018/12/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		3.7500			1,729	1,950	233,421	2021/05/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		2.5000			1,100	1,156	138,393	2019/05/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		3.7500			1,901	2,191	262,266	2024/09/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		3.5000			1,938	2,219	265,627	2030/03/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		2.1500			1,593	1,688	202,077	2021/12/15	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		1.5000			1,246	1,282	153,495	2019/08/01			
国 小 計	銘 金 柄 数 額	64銘柄									105,758	121,214	14,509,366		
ユーロ (フィンランド)		Finland Government Bond	国	債	証	券		0.3750			千ユーロ	千ユーロ			
		Finland Government Bond	国	債	証	券		0.7500			432	445	53,371	2020/09/15	
		Finland Government Bond	国	債	証	券		0.8750			414	411	49,285	2031/04/15	
		Finland Government Bond	国	債	証	券		0.5000			279	292	35,065	2025/09/15	
		Finland Government Bond	国	債	証	券		—			411	414	49,639	2026/04/15	
		Finland Government Bond	国	債	証	券		—			200	199	23,929	2023/09/15	
		Finland Government Bond	国	債	証	券		4.3750			416	470	56,341	2019/07/04	
		Finland Government Bond	国	債	証	券		4.0000			667	882	105,596	2025/07/04	
		Finland Government Bond	国	債	証	券		3.3750			632	716	85,742	2020/04/15	
		Finland Government Bond	国	債	証	券		3.5000			459	537	64,392	2021/04/15	
		Finland Government Bond	国	債	証	券		2.7500			389	484	58,009	2028/07/04	
		Finland Government Bond	国	債	証	券		1.6250			612	677	81,098	2022/09/15	
		Finland Government Bond	国	債	証	券		1.5000			446	491	58,786	2023/04/15	
		Finland Government Bond	国	債	証	券		2.6250			407	558	66,799	2042/07/04	
Finland Government Bond	国	債	証	券		1.1250			425	438	52,537	2018/09/15			
Finland Government Bond	国	債	証	券		2.0000			529	603	72,291	2024/04/15			
国 小 計	銘 金 柄 数 額	15銘柄									6,718	7,626	912,887		
ユーロ (オーストリア)		Austria Government Bond	国	債	証	券		0.2500			千ユーロ	千ユーロ			
		Austria Government Bond	国	債	証	券		1.2000			527	539	64,592	2019/10/18	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		0.7500			873	939	112,451	2025/10/20	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		1.5000			576	588	70,442	2026/10/20	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		6.2500			234	245	29,375	2047/02/20	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		4.6500			985	1,575	188,607	2027/07/15	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		3.9000			1,066	1,131	135,386	2018/01/15	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		3.5000			1,248	1,446	173,136	2020/07/15	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		4.1500			1,337	1,583	189,521	2021/09/15	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		4.3500			1,073	1,692	202,604	2037/03/15	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		4.8500			989	1,102	131,978	2019/03/15	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		3.6500			675	953	114,130	2026/03/15	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		3.4000			797	963	115,327	2022/04/20	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		3.8000			872	1,056	126,485	2022/11/22	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		1.9500			318	574	68,743	2062/01/26	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		3.1500			738	787	94,228	2019/06/18	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		1.7500			623	907	108,628	2044/06/20	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		2.4000			959	1,076	128,848	2023/10/20	
		Austria Government Bond	国	債	証	券		1.1500			501	620	74,222	2034/05/23	
Austria Government Bond	国	債	証	券		1.6500			426	440	52,781	2018/10/19			
Austria Government Bond	国	債	証	券		1.6500			932	1,039	124,444	2024/10/21			
国 小 計	銘 金 柄 数 額	20銘柄									15,749	19,264	2,305,937		
通貨小計	銘 金 柄 数 額	287銘柄									429,990	509,542	60,992,290		
合 計	銘 金 柄 数 額	742銘柄											152,458,096		

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	152,458,096	98.2
コール・ローン等、その他	2,858,154	1.8
投資信託財産総額	155,316,251	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＝112.42円、1カナダ・ドル＝83.68円、1オーストラリア・ドル＝84.14円、1シンガポール・ドル＝78.97円、1イギリス・ポンド＝140.46円、1スイス・フラン＝111.11円、1デンマーク・クローネ＝16.09円、1ノルウェー・クローネ＝13.18円、1スウェーデン・クローネ＝12.25円、1メキシコ・ペソ＝5.45円、1マレーシア・リンギット＝25.18円、1南アフリカ・ランド＝8.10円、1ポーランド・ズロチ＝26.99円、1ユーロ＝119.70円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（153,945,576千円）の投資信託財産総額（155,316,251千円）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

2016年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	資 産	負 債
(A) 資産	156,305,910,305円	
コール・ローン等	1,633,359,114	
公社債(評価額)	152,458,096,613	
未収入金	1,004,815,170	
未収利息	1,181,963,343	
前払費用	27,676,065	
(B) 負債	1,328,781,046	
未払金	989,797,739	
未払解約金	338,983,307	
(C) 純資産総額(A－B)	154,977,129,259	
元本	59,006,131,580	
次期繰越損益金	95,970,997,679	
(D) 受益権総口数	59,006,131,580口	
1万口当り基準価額(C／D)	26,265円	

* 期首における元本額は57,305,049,313円、当期中における追加設定元本額は5,269,599,218円、同解約元本額は3,568,516,951円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスV A 1,426,188,983円、ダイワ国内重視バランスファンド3 0 V A（一般投資家私募）47,463,120円、ダイワ国内重視バランスファンド5 0 V A（一般投資家私募）340,370,920円、ダイワ国際分散バランスファンド3 0 V A（一般投資家私募）85,931,327円、ダイワ国際分散バランスファンド5 0 V A（一般投資家私募）1,134,382,139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）45,058,356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）79,097,081円、Dー1's 外国債券インデックス850,783円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 17,978円、iFree 外国債券インデックス71,282,917円、iFree 8資産バランス23,335,905円、D Cダイワ外国債券インデックス38,020,240,928円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 588,263,235円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 260,217,655円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 159,536,254円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）251,573,954円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）202,071,895円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）59,946,308円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 12,384,412円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 15,705,795円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 932,613円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A 1,705,288,856円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 194,065,438円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 7,200,012,883円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 519,885,779円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 335,883,404円、ダイワ・バランスファンド2 5 V A（適格機関投資家専用）396,659,545円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券103,331,290円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド7,209,795円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,614,367,146円、ダイワライフスタイル2 5 35,139,131円、ダイワライフスタイル5 0 55,152,766円、ダイワライフスタイル7 5 14,282,989円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は26,265円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月1日 至2016年11月30日

項 目	当 期	
	当	期
(A) 配当等収益		3,752,837,785円
受取利息		3,754,140,257
支払利息	△	1,302,472
(B) 有価証券売買損益	△	16,772,505,959
売買益		1,450,751,670
売買損	△	18,223,257,629
(C) その他費用	△	38,790,637
(D) 当期損益金(A + B + C)	△	13,058,458,811
(E) 前期繰越損益金		106,347,261,037
(F) 解約差損益金	△	6,002,567,503
(G) 追加信託差損益金		8,684,762,956
(H) 合計(D + E + F + G)		95,970,997,679
次期繰越損益金(H)		95,970,997,679

(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。