

★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60% 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20% 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15% 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5% また、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。 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。 ⑤株式以外の資産への投資は、原則として、信託財産総額の75%以下とします。	
	組入制限	ベビーファンドの 株式実質投資比率 無制限 ベビーファンドの株式以外 の資産への投資上限比率 原則として信託財産総 額の75%以下 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75

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75」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	株式先物比率	公社債組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	税込分配金	期中騰落	中率	(ベンチマーク)	期中騰落						
13期末 (2012年11月30日)	円 7,401	円 0	% 10.1	7,313	% 9.2	% 73.5	% 1.4	% 24.3	% -	% 0.3	百万円 362
14期末 (2013年12月2日)	10,806	0	46.0	10,629	45.3	73.6	0.9	24.7	-	0.3	537
15期末 (2014年12月1日)	12,277	0	13.6	12,041	13.3	74.0	0.8	24.3	-	0.3	647
16期末 (2015年11月30日)	13,210	0	7.6	12,915	7.3	73.5	0.8	24.6	-	0.4	734
17期末 (2016年11月30日)	12,701	0	△ 3.9	12,377	△ 4.2	74.4	0.8	23.8	-	0.4	760

(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 60%
- 「日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券 20%
- 「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券 15%
- 「外国債券インデックスマザーファンド」の受益証券 5%

《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：13,210円

期末：12,701円

騰落率：△3.9%

■ 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、外国株式、外国債券が下落したことなど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。

ダイワライフスタイル75

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 証 券 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	13,210	% -	12,915	% -	% 73.5	% 0.8	% 24.6	% -	% 0.4
12月末	13,006	△ 1.5	12,713	△ 1.6	73.3	0.9	24.9	-	0.4
2016年 1 月末	12,291	△ 7.0	12,012	△ 7.0	71.5	1.5	26.0	-	0.4
2 月末	11,541	△12.6	11,286	△12.6	73.5	1.1	24.5	-	0.4
3 月末	11,991	△ 9.2	11,670	△ 9.6	73.1	1.4	24.5	-	0.4
4 月末	11,940	△ 9.6	11,641	△ 9.9	73.1	1.1	24.8	-	0.4
5 月末	12,176	△ 7.8	11,867	△ 8.1	73.5	1.2	24.2	-	0.4
6 月末	11,286	△14.6	11,003	△14.8	72.3	1.3	25.4	-	0.4
7 月末	11,785	△10.8	11,508	△10.9	73.8	0.7	24.5	-	0.4
8 月末	11,780	△10.8	11,507	△10.9	74.0	0.7	24.2	-	0.4
9 月末	11,741	△11.1	11,429	△11.5	73.3	1.1	24.7	-	0.4
10月末	12,132	△ 8.2	11,815	△ 8.5	73.8	1.0	24.3	-	0.4
(期末)2016年11月30日	12,701	△ 3.9	12,377	△ 4.2	74.4	0.8	23.8	-	0.4

(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まいります。

○トピックス・インデックス・マザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマーク（TOPIX）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

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）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、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（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：60%、日本債券：20%、外国株式：15%、外国債券：5%）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。

○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

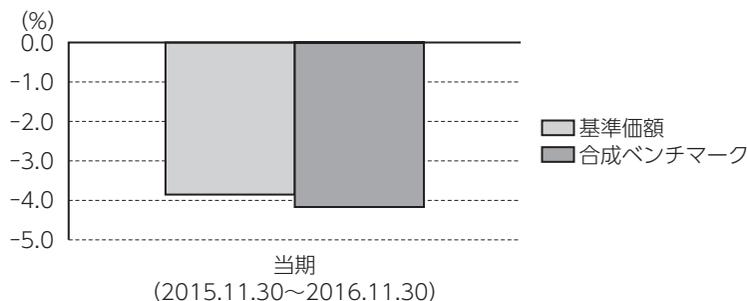
ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

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△4.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△3.9%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）	6,511

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

○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	116円	0.972%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,941円です。
(投信会社)	(45)	(0.378)	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)	(61)	(0.508)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(10)	(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	0.003	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)	(0.001)	
(先物)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.001	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)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	2	0.019	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)	(0.011)	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	119	0.994	

(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	65,852	53,030	17,800	14,591
日本債券インデックスマザーファンド	21,026	29,563	26,434	36,631
外国株式インデックスマザーファンド	9,265	16,544	3,671	6,773
外国債券インデックスマザーファンド	3,177	8,374	1,801	4,896

(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					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
株式	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0.4%

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

(3) 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					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
公社債	百万円 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0.3%

(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		
	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 末	
	口 数	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千口	
トピックス・インデックス・マザーファンド	465,107	513,159	458,610	
日本債券インデックスマザーファンド	109,548	104,139	145,879	
外国株式インデックスマザーファンド	54,023	59,617	116,188	
外国債券インデックスマザーファンド	12,907	14,282	37,514	

(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	率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	458,610	59.9
日本債券インデックスマザーファンド	145,879	19.1
外国株式インデックスマザーファンド	116,188	15.2
外国債券インデックスマザーファンド	37,514	4.9
コール・ローン等、その他	6,948	0.9
投資信託財産総額	765,140	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	765,140,968円
コール・ローン等	5,783,354
トピックス・インデックス・マザーファンド(評価額)	458,610,652
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	145,879,075
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	116,188,617
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	37,514,270
未収入金	1,165,000
(B) 負債	4,802,161
未払解約金	1,382,270
未払信託報酬	3,391,717
その他未払費用	28,174
(C) 純資産総額(A-B)	760,338,807
元本	598,654,336
次期繰越損益金	161,684,471
(D) 受益権総口数	598,654,336口
1万口当り基準価額(C/D)	12,701円

*期首における元本額は556,327,779円、当期中における追加設定元本額は85,325,672円、同解約元本額は42,999,115円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は12,701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	△ 744円
受取利息	378
支払利息	△ 1,122
(B) 有価証券売買損益	△ 13,832,475
売買益	10,806,652
売買損	△ 24,639,127
(C) 信託報酬等	△ 6,802,661
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 20,635,880
(E) 前期繰越損益金	181,305,000
(F) 追加信託差損益金	1,015,351
(配当等相当額)	(208,495,672)
(売買損益相当額)	(△207,480,321)
(G) 合計(D+E+F)	161,684,471
次期繰越損益金(G)	161,684,471
追加信託差損益金	1,015,351
(配当等相当額)	(208,495,672)
(売買損益相当額)	(△207,480,321)
分配準備積立金	181,305,000
繰越損益金	△ 20,635,880

(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	0
(c) 収益調整金	208,495,672
(d) 分配準備積立金	181,305,000
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	389,800,672
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	389,800,672
(h) 受益権総口数	598,654,336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75）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	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	柄	株数	金額	平均単価	
		千株	千円	円			千株	千円	円			千株	千円	円	
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						
ゆうちょ銀行		169.2	270,225	1,597	トヨタ自動車		37.08	245,831	6,629						
日本電信電話		39.9	190,130	4,765	三菱UFJフィナンシャルG		2.78	151,468	5,444						
トヨタ自動車		27.5	164,677	5,988	日産自動車		108.7	113,006	1,039						
九州旅客鉄道		43.1	129,912	3,014	東京エレクトロン		12.5	105,478	8,438						
東日本旅客鉄道		12.6	121,035	9,605	日本たばこ産業		24.7	99,580	4,031						
三菱UFJフィナンシャルG		181	92,890	513	アステラス製薬		52.4	84,522	1,613						
デンソー		20.9	92,877	4,443	富士フイルムHLDGS		18.7	73,950	3,954						
日本電産		9.6	90,069	9,382	東海旅客鉄道		4	71,489	17,872						
KDDI		26.5	81,365	3,070	武田薬品		14.5	69,327	4,781						

(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（141,237,185千円）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	柄	2016年11月30日現在 株数 評価額	銘柄	柄	2016年11月30日現在 株数 評価額	銘柄	柄	2016年11月30日現在 株数 評価額	銘柄	柄	2016年11月30日現在 株数 評価額
		千株 千円			千株 千円			千株 千円			千株 千円
水産・農林業 (0.1%)			鹿島建設		288 230,976	住友林業		44.7 69,955	千代田化工建		46 37,766
極洋	3.2	8,649	不動テトラ	57.6	12,268	日本基礎技術	13.7	4,603	新興プランテック	14.8	11,943
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%)		
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%)			興村組	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
日本海洋掘削	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	協和エクスオ	25.4	41,097	山崎製パン	48	108,912
タマホーム	10.1	5,534	大東建設	24	426,600	日電工	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	NI PPO	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	六甲パター	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	5.7	9,291	大氣社	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	ダイダイン	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	2016年11月30日現在		銘柄	2016年11月30日現在		銘柄	2016年11月30日現在		銘柄	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
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	共和レザー	6.2	4,929	太陽ホールディングス	4.8	21,264	白水製薬	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	鳥居薬業	4.3	10,238
オエノンホールディングス	29	7,453	住友化学	447	233,781	サカタインクス	12.2	18,275	JCRファーマ	4.9	14,014
コカ・コーラウエスト	22.1	71,604	日本化成	49	7,350	東洋インキホールディングス	5.5	28,600	東和薬品	2.9	11,962
コカ・コーラドジャパン	25.5	61,633	住友精化	2.6	11,206	T & K TOKA	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ナショナル	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
グアトールドリンコ	2.9	16,385	ラサニ工業	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	フレハ	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	4.1	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	日東エフシー	5.9	5,245	ミルボン	3.5	16,240	ダイト	3.9	7,807
J-オイルミルズ	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
キッコーマン	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	ペプチドリーム	10.4	59,280
キユーピー	33.5	90,550	セントラル硝子	62	28,024	ポーラ・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	2.4	62,875	大阪ソーダ	27	12,690	コニシ	9.9	12,642	昭和シエル石油	54.3	55,440
アリアケジャパン	53.4	30,888	関東電化	13	12,350	長谷川香料	7.6	14,774	ニチレイ	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	小川製薬	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
ロックフィールド	7.6	10,928	太陽日酸	47	58,844	タカラバイオ	13.2	19,285	JM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	JCU	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	日本パーカラライジング	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	デフセリアルズ	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	9,340	ブリヂストン	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%)			保士谷化学	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	日本農業	14.1	8,671	ニッタ	5.4	15,903
東洋紡	240	41,280	カネカ	81	73,791	アキレス	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
グアイロミテッド	18.8	7,595	三菱ケミカルHLDGS	407	292,836	藤澤化成工業	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	日本山形硝子	34	6,528
帯人	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
サカイ オーベックス	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
住江織物	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
アツギ	74	8,954	アイセ工業	19	57,190	東リ	22.2	8,436	日本ヒューム	8.9	6,107
セーレン	15.6	22,869	宇都興産	300	71,400	ニフコ	10.5	65,940	日本コンクリート	17.5	6,002
ソート	6.1	7,204	積水樹脂	9.5	16,473	日本バルカー	5.8	8,653	アシアパイルHD	11.1	5,638
東海染工	53	7,102	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
小松精練	11.9	7,961	旭有機材	33	7,161	医薬品 (4.8%)			日本カーボン	36	8,928
ワコールホールディングス	35	46,445	日立化成	33.5	84,085	協和発酵キリン	73.2	119,462	東洋炭素	4	6,748
ホギメディカル	3.9	26,208	ニチパン	7	5,915	武田薬品	228.7	1,071,459	ノリタケ	3.6	9,316
T S Iホールディングス	24.8	16,293	リケンテクノス	14.2	7,795	アステラス製薬	623.6	984,976	TOTO	44.8	196,448
三陽商会	40	6,320	大倉工業	19	9,709	大日本住友製薬	42.9	80,180	日本碍子	77.1	168,540
オンワードホールディングス	38	28,538	積水化成品	9	7,209	塩野義製薬	82.7	447,407	日本特殊陶業	52.7	123,634
ゴールドウイン	2.7	13,392	群衆化学	1.8	5,400	田辺三菱製薬	71	152,721	MA RUWA	2.4	9,564
デサント	14.1	17,667	タイガース ポリマー	6.4	4,294	あすか製薬	7.1	12,048	品川リフトラクトリーズ	25	6,325
パルプ・紙 (0.2%)			ダイキョーニシカワ	10.8	15,336	日本新薬	14.1	75,012	黒崎播磨	18	5,724
特種東海製紙	3.7	14,781	日本化学	39	51,792	中外製薬	61	196,115	フジミンコーポレートッド	5.6	11,076
王子ホールディングス	232	108,808	カーリットホールディングス	13.3	7,102	科研製薬	11.4	69,312	ニチアス	32	35,424
日本製紙	26.5	52,417	日本精化	8.4	6,879	エーザイ	75.1	496,335	ニチハ	8.3	23,870
三菱製紙	11.6	8,700	扶桑化学工業	4.4	11,184	ロート製薬	29.6	47,833	鉄鋼 (1.3%)		
北越紀州製紙	32.8	21,516	ADEKA	25.1	38,628	小野薬品	139.1	352,409	新日鐵住金	275.1	674,820
中越パルプ	28	6,720	日油	48	50,832	久光製薬	17.2	94,600	神戸製鋼所	104.3	112,539
巴川製紙	19	4,826	花王	155.3	817,965	持田製薬	4.1	32,595	中山製鋼所	7.8	5,522
大王製紙	24	30,192	第一工業製薬	19	6,707	参天製薬	112.1	156,491	合同製鐵	3.7	8,036
レングロー	58.3	39,469	三洋化成	3.5	16,905	扶桑薬品	2.7	7,457	JFEホールディングス	166.4	277,888
トーモク	24	7,680	大日本塗料	37	8,029	日本ケミファ	1.3	6,955	日新製鋼	27.4	40,141
ザ・パックス	4.5	11,650	日本ペイントHOLD	47.2	170,392	ツムラ	20.4	63,138	東京製鐵	30.6	25,245
			関西ペイント	63.8	133,661	日医工	14.2	22,450	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	2016年11月30日現在 評価額	銘柄	株数	2016年11月30日現在 評価額	銘柄	株数	2016年11月30日現在 評価額	銘柄	株数	2016年11月30日現在 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	能美防災	6.9	12,413
大阪製鐵	4.2	8,757	牧野フライス	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	オーエスジー	27.4	61,951	セガサミーホールディングス	57.7	98,667	エレクトロ	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	7.1	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	ディソック	16	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	36.3	20,628	O K K	6.7	7,839	大豊工業	5.2	8,320	ソニー	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
日本鋸鉄管	25	4,725	ナプテスコ	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
シンエツタン	11.4	6,897	レオン自動機	6.6	5,900	イーブル工業	6.5	9,912	日本トリム	1.5	6,405
非鉄金属 (0.9%)			S M C	18.3	595,116	日本ピラー工業	7.3	8,898	ローランド ティー・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	オリエス工業	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	日精樹脂工業	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
古河機金	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	古野電気	8.7	6,933
U A C J	78	25,740	井関農機	63	14,301	ユニカミノルタ	135	147,420	古田ホールディングス	40	6,280
古河電工	20.2	71,407	T O W A	5.7	7,643	プラザ工業	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	ミネベア	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	ロッキン	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	富士電機	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	帝国電機製作所	6.8	5,909	安川電機	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	共和電気	15.5	6,200
宮地エンジニアリング	3.2	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
トスカロ	44	10,898	小森コーポレーション	14.6	21,345	アソテック	5.7	8,287	アドバンテス	39.5	61,264
S M C O	63.9	80,066	鶴見製作所	5.2	8,949	東芝メック	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	芝浦テクノロジクス	18	4,752	キーンズ	13.2	1,032,636
東洋製鐵グループHD	42.6	91,760	荏原製作所	25.1	74,647	マフチモーター	16.5	105,105	日置電機	3.5	7,234
ホッパホールディングス	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 G R O U P	3.5	18,480
文化シヤッター	17.6	15,294	トヨーカーネツ	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
アルコン	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	アナステ岩田	11.5	13,064	大崎電気	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	岩崎電気	38	6,612
岡部	13.4	13,534	タノ	30.3	36,905	ジーエス・エアサ コーポ	111	51,171	ウシオ電機	35.4	48,816
ジーテクト	6.4	13,548	フジテック	17.1	21,460	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	C K D	17.5	24,080	メルコホールディングス	3.4	9,945	遠藤照明	6.4	5,459
高周波熱錬	12	10,896	キトー	8.5	9,503	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	平和	17.7	43,559	沖電気	562	379,237	古河電池	6	4,854
パイオラックス	3.1	21,297	理想科学工業	6	11,874	富士通	25	38,550	山一電機	6.8	7,337
日本発条	56	60,032	S A N K Y O	15.8	57,117	電気興業	18	10,458	図研	5.3	5,861
三益半導体	5.3	7,266	日本金銭機械	5.9	9,180	サンケン電気	35	16,975	日本電子	2.2	9,922
機械 (5.1%)			マースエンジニアリング	3.5	7,192	アイホン	4.1	7,576	カシオ	48.7	72,806
日本製鋼所	20.4	41,473	福島工業	3.8	12,540	ルネサスエレクトロニクス	32.1	27,477	ファンック	59.1	1,140,925
三浦工業	25.1	43,322	ダイコク電機	3.3	5,629	セイコーエプソン	86.6	198,573	日本シイエムケイ	13.8	8,280
タクマ	20	19,200	竹内製作所	10.8	26,330	ワコム	46.5	14,275	エンプラス	2.7	8,896
ツガミ	18	11,340	アマノ	17.9	34,350	アルバック	10.7	36,754	ローム	28.2	176,250
オークマ	39	39,039	J U K I	10.2	9,924	アクセル	5.2	4,420	浜松トトニクス	45.4	137,789
東芝機械	37	15,910	サンデンホールディングス	37	13,505	E I Z O	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	蛇の目マシン	7.3	5,810	ジャパンディスプレイ	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	マックス	9	12,114	日本信号	16.1	14,779	京セラ	95.6	519,681

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
太陽誘電	27.5	34,237	日機装	20	20,760	北海道電力	54.8	45,484	キューソー流通システム	2.3	5,317
村田製作所	61.2	944,010	島津製作所	75	130,725	沖繩電力	8.5	19,754	郵船ロジスティクス	6	6,684
ユニー	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	パイ・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	4.5	5,760	東京計器	32	6,880	東京瓦斯	625	311,687	内外トランスライン	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	マニー	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	オリンパス	92.8	373,056	西部瓦斯	67	16,482	新日鉄住金 SOL	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	TIIS	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	シグマ時計	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	大研工業	6.9	5,747	京浜急行	159	195,411	K Lab	12.2	7,844
ユニプレス	11.2	24,539	ミニコン	4.1	11,894	小田急電鉄	93.4	208,935	ホールックウィン・ピットル	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	テクノシステム	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
三井造船	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	45.3	163,533	前田工業	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	永大産業	13	6,383	西武ホールディングス	80.4	164,900	ティエーガイア	5.8	9,900
日本車輛	26	7,384	アードネイチャー	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	テックマトリックス	2.5	4,710
いすゞ自動車	169.1	228,115	ハンダインコムLDGS	64.3	209,939	ハマキョウレックス	4.3	8,823	カホ・オライヴ・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 HO E I	3.2	6,492	近鉄グループHDLDGS	58.5	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HDLDGS	7.8	7,105	阪急阪神HDLDGS	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	SRA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	トップパン・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	フジीलインターショナル	6.6	30,558	名古屋鉄道	212	118,932	gumi	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	LINE	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
トビー工業	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	TDVソフトウェアアジア	4.7	5,278
フタバ産業	19.2	13,286	宝印刷	4.8	6,744	ニッコンホールディングス	19.4	46,404	ヤフー	418.7	174,179
K Y B	65	33,800	アシックス	57.9	139,423	福山通運	34	21,250	トレンドマイクロ	30.5	125,355
大同メタル工業	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	日本オラクル	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	ピジヨン	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	リントック	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	NS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	ココロ	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	21	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	グループライド	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	アルコグラフィックス	3.7	8,047
愛三工業	9.9	9,197	東京電力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	中部電力	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	3.6	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	16.3	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J SATHD	37.7	20,584

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2016年11月30日現在		銘柄	2016年11月30日現在		銘柄	2016年11月30日現在		銘柄	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
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	ソーラーポレーション	8.8	5,544	千趣会	11.4	8,561
コネクシオ	5.3	7,420	シークス	4.1	15,703	ワック	6.9	7,217	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
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
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
光通信	6.9	70,380	長瀬産業	32	45,888	グンキー	1.2	6,756	いなげや	6.6	9,405
N T T 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
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
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
カドカワ	16.9	26,347	三井物産	521.2	803,429	フオール	6.9	10,101	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
ゼンリン	37	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
松竹	8	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
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
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
N T T 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
D T S	6.3	15,951	住友商事	361.5	493,447	ドトール・日レスHD	9.9	21,057	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	エイチ・ツー・オーリテイリング	29	49,619
シーエーシー	3.9	7,386	三菱商事	432.4	1,068,676	プロコムリニ	3.3	10,048	近鉄百貨店	23	8,119
カプコン	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
ジャストテック	5.9	6,065	キャノンマーケティング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
S C S K	15.8	62,805	西華産業	23	7,544	ココカラファイン	6.1	25,559	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
T K C	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
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	イズミ	6.5	14,456
N S D	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
コナミホールディングス	26	100,620	カナデン	7.6	7,706	ジュニー	2	5,762	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	シヨウフル本田	9.2	29,578	ケーズホールディングス	26.1	55,123
J B C Cホールディングス	15	10,335	岩谷産業	62	38,378	扇貴族	1.6	3,995	アイホールディングス	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
ソフトバンクグループ	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
卸売業 (4.4%)			稲畑産業	13.6	16,442	ユナイテッド・スーパーマーケット	18.8	17,634	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	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
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
双日	335.7	97,353	ミツウロコグループ	9.6	6,758	コスモ薬品	2.9	60,697	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
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
下田医科器械	3.3	5,626	サンリオ	17.3	34,842	山王堂	3.3	7,306	アレスナ	6.3	14,061
アルコニック	5.2	8,288	リョーサン	8.4	28,896	クワイート・リストランツ・ホール	15.6	15,709	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	ツルハホールディングス	13.3	155,344	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
ダイブイェックス	3.7	5,106	三信電業	7.5	7,042	トリドールホールディングス	7.2	17,820	ベルク	2.7	11,110
ゲイワボウHD	49	14,749	東陽テクニカ	8.3	7,926	ダイユー・リックHLDGS	9.5	6,374	大庄	4.4	6,793
マクカ・富士IHLDGS	10.5	14,280	モスフード サービス	7.4	25,197	クワリのアオキHLDGS	5.3	25,784	ファーストリテイリング	9.6	379,872
バイタルK S K HD	10.6	10,207	加賀電子	5.7	10,790	総合メディカル	3.1	10,772	サンドラップ	11	87,560
U K Cホールディングス	4.2	8,794	P A L T A C	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
TOKAIホールディングス	25.2	19,000	ヤマナ	6.1	9,058	カッパ・クリエイト	8.8	10,876	ペルルーナ	15.5	9,920
三洋貿易	5	7,675	丸紅建材リース	28	5,712	ライトオン	5.1	5,161	銀行業 (8.3%)		
ワイン・パートナーズ	3	5,553	日鉄住金物産	4.7	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
シッパルススクエアHD	10.9	32,558	トラスコ中山	6.7	34,706	アドヴァン	6.8	7,568	めがきフィナンシャルG	276.4	114,982
コメ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T V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
佐島電機	8.9	6,336	イネック	10.7	5,628	コーナン	8.1	17,520	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
コンドレーテック	8.3	6,714	日伝	2.5	7,850	ドンキホーテホールディング	37.3	163,187	コソルディア・フィナンシャル	374.9	197,009
ナゴイレーベン	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
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
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
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
メディアバルHD	57.4	93,963	小売業 (4.8%)			V Tホールディングス	20.4	11,383	リソナホールディングス	67.2	369,777
萩原電業	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
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
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
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
小津産業	2.6	5,449	ハードオフコーポレーション	4.4	5,073	クロフワ	18.8	35,644	千葉銀行	220	149,160
黒田電気	7.8	17,924	アスフル	7.1	29,216	菅屋屋	5.2	19,500	群馬銀行	124.7	72,450
丸文	8.2	5,608	グオホールディングス	9.1	11,637	シキホールディングス	12.6	67,284	武蔵野銀行	8.7	26,665
ハイネット	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
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
エケセル	3.4	4,885	キャンドウ	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
マルカキカイ	3.5	4,949	パルグルーパHLDGS	3.2	9,497	木曾路	7.1	16,209	青森銀行	45	19,920

銘柄		2016年11月30日現在		銘柄		2016年11月30日現在		銘柄		2016年11月30日現在		銘柄		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	株数	評価額	株数	評価額	株数	評価額	株数	評価額
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	千株	千円		
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	アサヒ	3.6	6,116				
岩手銀行	3.6	16,596	マックス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	カブネットコム証券	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	岩井證券ホールディング	8	7,776	エフ・ジェー・ネクスト	8.2	5,805	ベルシス24HL DGS	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	リゾグループ	2.3	36,110				
静岡銀行	155	143,375	マオ・パートナーズGP	8.6	4,128	日本空港ビルデング	18.4	78,292	東洋	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	イネンホールディングス	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	84	15,456				
福井銀行	51	14,229	SONY FH	54.7	90,255	アコディア・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HL DGS	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	1.5	7,035				
滋賀銀行	49	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				
南都銀行	5.4	22,437	Aドバンスクリエイト	3	5,361	CDS	8	8,088	常磐興産	5.2	7,987				
百五銀行	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				
京都銀行	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	35,107	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	ニニカル	4.1	5,366	乃村工務社	13.2	22,096				
広島銀行	168	84,672	東京証券シュリー	11.5	42,492	クワッド	14.2	14,569	藤田建設	22	7,238				
山陰合同銀行	34.3	29,943	日本証券金融	25.9	14,115	スタジオアリス	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	リコーリース	4.5	15,750	総合整備保障	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	ルカコス	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	オエフJ 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グ	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	学芸社	4.7	6,401				
沖縄銀行	5.6	23,940	イー・ギヤランティ	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D Y H L DGS	84.5	112,216	ニチヤ学園	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・エルジータカミヤ	8.5	5,576	千株	千円					
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<金額>	88,072.5	124,953,943				
長野銀行	3.2	6,428	野村不動産HL DGS	37.6	69,635	ファンコミュニケーションズ	15.8	11,865	銘柄数<99.9%>	1,501	1,500				
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							
北洋銀行	90	40,320	サムティ	5.6	5,964	インフォーマット	13.5	15,714	(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価						
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	総額に対する各業種の比率。						
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2) 合計欄の<>内は、純資産総額						
中京銀行	2.8	6,599	ユニゾホールディングス	4.9	15,998	プレスステージ・インター	9.8	7,918	に対する評価額の比率。						
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	(注3) 評価額の単位未満は切捨て。						
愛媛銀行	5.2	7,098	フージャースHD	11.1	6,737	ドリムインキュベータ	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	みからホールディングス	15.5	79,360							
東和銀行	118	12,744	三菱地所	428	986,754	オリックス技研	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							
トモエホールディングス	47	27,730	ダイビル	14.9	15,183	明光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							
F P G	21.2	19,355	テオージャ	22.7	22,450	ビー・エム・エル	8.1	21,335							
S B Iホールディングス	64.8	92,793	東京薬天地	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	スターコーポレーション	6.1	12,724	ユニー・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	デー・オー・ダブリュー	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	8	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	ジャパネットマテリアル	2.4	8,916							

(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	百万円	百万円
TOPIX	1,179	-

(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	2,649,900	-	株
	(1,821,200)	-	(-)

(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株を貸付しています。

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第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

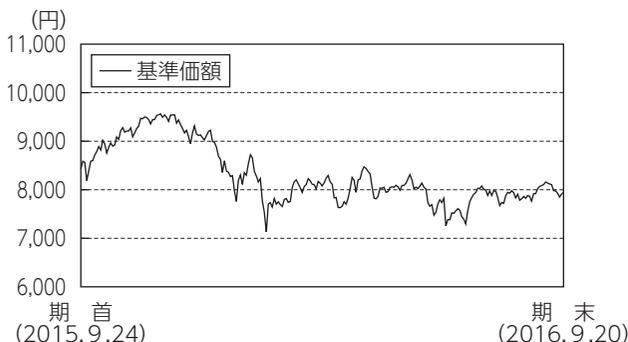
大和投資信託

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		T O P I X (ベンチマーク)		株式組入比率	
	円	騰落率	円	騰落率	%	%
(期首)2015年9月24日	8,429	-	1,426.97	-	99.1	0.9
9月末	8,400	△ 0.3	1,411.16	△ 1.1	98.0	2.0
10月末	9,275	10.0	1,558.20	9.2	98.5	1.6
11月末	9,409	11.6	1,580.25	10.7	99.1	1.0
12月末	9,225	9.4	1,547.30	8.4	98.7	1.3
2016年1月末	8,539	1.3	1,432.07	0.4	98.0	2.1
2月末	7,739	△ 8.2	1,297.85	△ 9.0	98.8	1.4
3月末	8,110	△ 3.8	1,347.20	△ 5.6	98.1	1.9
4月末	8,068	△ 4.3	1,340.55	△ 6.1	98.6	1.5
5月末	8,310	△ 1.4	1,379.80	△ 3.3	98.3	1.7
6月末	7,513	△ 10.9	1,245.82	△ 12.7	98.3	1.8
7月末	7,979	△ 5.3	1,322.74	△ 7.3	99.1	0.8
8月末	8,020	△ 4.9	1,329.54	△ 6.8	99.3	0.7
(期末)2016年9月20日	7,944	△ 5.8	1,316.97	△ 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T O P I X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E C B（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、E C B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E C B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E U（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、T O P I Xに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（T O P I X）の騰落率は△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、ベンチマークとかい離しました。

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	0円
(株式)	(0)
(先物)	(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 株式先物取引	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			期末			銘柄	期首			期末			銘柄	期首			期末		
	株数	株数	千円	株数	株数	千円		株数	株数	千円	株数	株数	千円		株数	株数	千円	株数	株数	千円
水産・農林業 (0.1%)							ユアテック						ハウス食品G本社							
極洋	37	35	9,485				千株	千株	千円	千株	千円	千株	千円	23.1	21.9	49,187				
日本水産	86.2	77.9	34,509				中電工	9.7	7.5	14,865			カゴメ	21	23.1	57,495				
マルハニチロ	15.3	14	34,692				関電工	29	26	23,842			アリアケジャパン	6.1	5.6	29,400				
サカタのタネ	11	10.7	27,552				きんでん	40.7	35.1	39,768			ニチレイ	71	71	75,331				
ホクト	7.5	7	12,558				東京エネシス	6	8	7,624			東洋水産	32.6	31.5	136,552				
鉱業 (0.3%)							トーエネック	12	11	5,225			日清食品HD	26.5	27.2	165,376				
日鉄鉱業	23	20	7,760				住友電設	6.1	6	6,210			永谷園ホールディングス	8	8	10,080				
三井松島	66	57	6,840				日本電設工業	10.6	9.9	17,641			一正浦鉾	0.4	-	-				
国際石油開発帝石	333.5	338.9	280,168				協和エクス工業	26.7	25.3	36,583			フジコ	7	6.9	14,959				
日本海洋掘削	2.2	2.5	5,552				九電工	12	12.2	41,236			ロックフィールド	4.2	8.4	11,944				
石油資源開発	9.1	10.2	21,205				三機工業	13.9	14.3	11,954			日本たばこ産業	375.6	361.7	1,434,502				
K&Oエナジーグループ	5.2	5.1	7,007				日揮	64	65	109,785			わらべや日洋HD	4.4	4.1	8,122				
建設業 (3.1%)							中外炬工業	28	34	6,766			ユーグレナ	21	22.5	32,625				
ショーボンドHD	6	6.8	31,042				太平電業	10	10	9,590			ミヨシ油脂	48	95	11,875				
ミライト・ホールディングス	20.7	20.4	17,748				高砂熱学	17.7	18.6	27,583			繊維製品 (0.8%)							
安藤・間	44.4	44.7	27,267				明星工業	14	13.9	6,463			片倉工業	9.2	8.9	10,306				
東急建設	23.9	22	21,538				大気社	9.5	7.4	18,352			グンゼ	50	49	15,337				
コムシスホールディングス	28.5	27.1	49,836				ダイダイン	11	10	7,830			東洋紡	253	244	40,016				
ミサワホーム	9.5	8.9	6,764				日比谷総合設備	9	8.6	14,052			エニチカ	235	233	13,048				
髙松ストラクチャーG.P	5.3	4.8	11,992				富士紡ホールディングス	10.1	9.9	15,780			日清紡ホールディングス	36	37	10,508				
東建コーポレーション	2.7	2.8	20,888				東洋エンジニア	33	35	10,885			倉敷紡績	72	58	10,556				
大成建設	328	340	258,400				千代田化工建	46	47	37,506			シキボウ	69	121	13,068				
大林組	190	196	193,256				新興プランテック	14.4	13.5	9,517			日本毛織	20	18.6	12,982				
清水建設	193	199	177,110				食品 (4.9%)						ダイドーリミテッド	15.6	14.7	6,012				
飛鳥建設	46.7	62	10,726				日本製粉	39	43	32,379			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				日清製粉G本社	70	71	107,352			帝人	246	248	97,712				
松井建設	11	10.3	11,433				昭和産業	30	27	13,986			東レ	456	439	422,625				
銭高組	7	18	6,246				中部飼料	4.8	8.5	6,069			サカイ オーベックス	-	58	11,136				
鹿島建設	277	306	213,588				フィード・ワン	61.9	54.7	6,235			住江織物	24	37	8,251				
不動テトラ	52.8	51.3	8,669				日本甜菜糖	49	49	9,408			日本バイリーン	13	-	-				
鉄建建設	42	43	13,416				三井製糖	29	28	13,020			芦森工業	47	7	7,050				
西松建設	70	75	34,350				森永製菓	62	61	54,717			アツギ	90	89	9,434				
三井住友建設	264	255.1	24,744				中村屋	23	23	10,373			セーレン	17	16.1	18,756				
大豊建設	19	27	14,553				江崎グリコ	14.7	15.1	82,899			小松精練	15.7	13.2	8,448				
前田建設	43	40	33,360				不二家	43	51	10,200			ワコールホールディングス	34	33	36,399				
オカノフード建設	3.5	15.2	5,973				山崎製パン	46	48.4	119,257			ホクメディカル	3.8	3.8	27,398				
奥村組	60	58	32,422				ヤクルト	4	44	5,500			T S Iホールディングス	28.2	27.6	15,538				
東鉄工業	8.1	8	22,392				モロゾフ	24	21	9,051			三陽商会	39	37	5,883				
浅沼組	17	37	7,992				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				
戸田建設	80	76	39,140				寿スピリッツ	2.2	5.7	13,149			ゴールドウイン	16	28	14,700				
熊谷組	83	97	25,608				カルビー	23.4	24.1	91,459			デサント	14.9	14.4	17,668				
北野建設	20	33	8,415				森永乳業	60	59	44,368			パルプ・紙 (0.3%)							
三井ホーム	16	13	5,954				六甲バター	1.7	4	11,488			特種東海製紙	40	38	12,692				
矢作建設	10.7	10.1	9,059				ヤクルト	33.9	35.3	167,498			王子ホールディングス	243	229	92,516				
ピーエス三菱	-	20.3	7,064				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				
日本ハウスHLDGS	14.1	27.2	10,390				雪印メグミルク	15.4	15.7	54,243			三菱製紙	121	111	7,548				
大東建託	23.3	24.4	390,278				プリマハム	41	46	16,376			北越紀州製紙	40.6	39.5	24,608				
新日本建設	4.7	10.7	9,416				日本ハム	47	47	113,975			中越パルプ	28	30	6,750				
N I P P O	14	15	28,605				伊藤ハム	36	-	-			大王製紙	27	27.2	32,504				
東亜道路	16	27	6,831				丸大食品	37	36	17,280			レンゴー	52	53	33,125				
前田道路	20	19	34,276				米久	1.4	-	-			トーモク	27	24	6,600				
日本道路	21	20	7,860				S Foods	4.9	4.6	12,084			ザ・バック	4.9	4.7	12,064				
東亜建設	53	61	10,797				伊藤ハム米久HLDGS	-	41.9	42,360			化学 (6.4%)							
若築建設	44	92	13,248				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				
東洋建設	20.6	22.4	9,497				アサヒグループホールディング	118.9	122.7	436,443			旭化成	369	378	302,173				
五洋建設	72.4	73.1	39,766				キリンHD	256.4	281	457,889			共和レザー	-	6.3	4,794				
大林道路	9	9.1	5,651				宝ホールディングス	51.9	47.3	44,083			昭和電工	410	40.8	51,122				
世紀東急	12.3	13.3	6,809				オノンホールディングス	35	60	13,200			住友化学	435	445	203,810				
福田組	11	12	12,468				コカ・コーラウエスト	21.1	22.1	55,338			住友精化	14	14	9,506				
住友林業	47	44.6	59,808				コカ・コーラ・ストザパシ	22.1	23.2	45,286			日産化学	39	36.7	113,586				
日本基礎技術	5.2	26.2	8,515				サントリー食品インター	42.8	45.5	192,010			ラサ工業	-	41	4,264				
日成ビルド工業	24	22	10,208				ダイドードリンク	3.2	3.4	18,564			クレハ	43	45	16,515				
ヤマダ・エスバイホーム	52	-	-				伊藤園	18.4	19.3	65,330			テイカ	15	14	7,182				
パコーポレーション	14.7	-	-				キーコーヒー	6.4	6.7	12,750			石原産業	113	120	7,920				
バナース	25	25	19,600				日清オイログループ	35	36	16,488			日東エフシー	-	5.8	4,645				
大和ハウス	186.9	193	513,283				不二製油グループ	17.1	17.5	34,790			日本曹達	41	41	17,302				
ライト工業	11.2	13.4	15,624				J-オイルミルズ	33	32	11,296			東ソ-	156	164	100,860				
積水ハウス	199	217.3	363,434				キッコマン	52	49	156,800			トクヤマ	101	110	38,060				
日特建設	11.2	18.6	8,872				味の素	146	138.1	307,134			セントラル硝子	63	66	26,004				
							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		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額	
大阪ソーダ	千株	千株	千円		星光PMC	千株	千株	千円		出光興産	千株	千株	千円		
29	28	11,032			2.1	5.6	6,406			28.1	31.2	61,869			
関東電化	16	16	13,744		小林製菓	9.6	18.2	93,548		650.2	712.9	280,098			
デンカ	127	127	57,277		荒川化学工業	6.7	6.2	7,440		—	—	21,948			
信越化学	106.4	109	766,270		メック	6.3	—	—		ゴム製品 (0.9%)					
日本カーバイド	26	85	11,730		日本高純度化学	3.5	3.1	7,012		横濱ゴム	34.8	36.4	59,441		
堺化学	28	28	8,904		タカラバイオ	—	12.2	20,056		東洋ゴム	27.5	27.5	37,345		
エア・ウォーター	51	49	92,071		JCU	1.9	2.3	8,441		ブリヂストン	199.9	206.1	747,730		
太陽日酸	75.6	45.9	47,644		新田ゼラチン	6	6.9	4,836		住友ゴム	52.6	55.8	86,322		
日本化学工業	17	32	7,328		デクセラリアルズ	12.1	17.8	15,806		藤倉ゴム	6.7	—	—		
日本パーカライズン	28.1	29.3	39,525		アース製薬	4.3	4.5	20,385		オカモト	25	20	24,280		
高圧ガス	11	12	7,824		イハラケミカル	10.1	10.3	8,713		ニッタ	6.4	5.9	13,764		
四国化成	10	10	9,160		大成ラミック	3.5	2.8	8,033		住友理工	11.3	13.3	12,701		
戸田工業	15	—	—		クミアイ化学	13.3	13.5	6,844		三ツ星ベルト	17	16	13,040		
ステラ ケミファ	4.9	4.4	15,532		日本農業	14.1	15.1	7,504		バンドー化学	25	25	11,700		
保土谷化学	31	34	8,874		アキレス	73	63	8,757		ガラス・土石製品 (0.9%)					
日本触媒	46	8.8	54,472		有沢製作所	11.6	11.1	5,649		日東紡績	48	43	14,061		
大日精化	28	24	11,232		日東電工	45.7	47.4	313,882		旭硝子	311	301	194,446		
カナカ	78	82	65,846		藤森工業	5.4	5.5	11,918		日本板硝子	306	315	25,830		
三菱瓦斯化学	99	102	70,992		前澤化成工業	7.2	7.4	7,622		日本山村硝子	35	30	5,130		
三井化学	272	259	120,694		ジェイ・エス・ピー	4.1	4.3	9,378		日本電気硝子	119	123	63,714		
JSR	56.8	56.8	88,835		エフピコ	5.4	5.3	28,408		住友大阪セメント	115	115	56,826		
東京応化工業	12.2	12.2	36,075		天馬	5.6	5.4	8,440		太平洋セメント	373	379	110,668		
三菱ケミカルLDGS	369	403.1	244,520		信越ポリマー	14.7	14.3	9,466		日本ヒュウム	8.5	8.1	5,094		
日本合成化学	15	15	13,605		東リ	28	22	6,732		日本コンクリート	12.9	23.9	7,958		
ダイセル	82.2	84.3	102,846		ニフコ	13.6	11.6	64,148		アジアパイルHD	10.2	16.6	7,038		
住友ベークライト	58	56	28,000		日本バルカー	36	33	9,042		東海カーボン	59	54	15,012		
積水化学	135	136	194,072		ユニ・チャーム	119.6	124	309,256		日本カーボン	35	36	6,156		
日本ゼオン	51	51	42,993		医薬品 (5.4%)					東洋炭素	3.7	4.1	5,313		
アイカ工業	17.9	17.6	46,006		協和発酵キリン	71	73	115,121		ノリタケ	41	37	8,621		
宇部興産	307	327	62,457		武田薬品	222.3	241.9	1,123,383		TOTO	88	44.7	169,636		
積水樹脂	10.2	8.7	13,928		アステラス製薬	664.4	662.5	1,039,793		日本硝子	75	77	162,701		
タキロン	17	17	7,667		大日本住友製薬	42.5	43.8	78,445		日本特殊陶業	50.6	51.9	95,184		
旭有機材	30	32	6,016		塩野義製薬	92.5	89.3	447,393		MARUWA	2	2.8	10,276		
日化化成	28.7	29.5	67,378		田辺三菱製薬	67.9	69.8	145,184		品川リフラクトリーズ	22	27	5,292		
ニチバン	—	9	6,669		あすか製薬	8.6	9.4	16,224		フジミンコーポレートッド	7	5.7	7,980		
リケンテクノス	12.4	13.5	6,466		日本新薬	14	14.1	71,346		ニチアス	29	31	26,443		
大倉工業	21	20	7,180		中外製薬	59.1	61.4	213,979		ニチハ	8.9	8.9	19,499		
積水化成品	21	18	6,210		科研製薬	21	10.5	63,315		鉄鋼 (1.2%)					
群栄化学	19	21	6,174		エーザイ	78.1	75.3	480,188		新日鐵住金	2,533	274.3	538,999		
日キョーニシカワ	1.7	8.6	10,397		ロート製薬	27.1	30.3	51,661		神戸製鋼所	1,021	1,107	99,630		
日本化薬	39	40	42,480		小野薬品	26.8	140	363,580		合同製鐵	40	41	7,134		
カーリットホールディングス	—	10.2	4,967		久光製薬	16.5	18.9	99,225		JFEホールディングス	150.8	164.7	237,662		
日本精化	8.2	7.9	5,988		持田製薬	4.1	4.3	34,916		日新製鋼	25.1	27.3	35,735		
ADEKA	26.6	27.8	38,058		参天製薬	108.6	111.6	159,699		東京製鐵	30.7	33.8	23,727		
日油	48	46	45,034		扶桑薬品	32	28	7,756		共英製鋼	6.7	7.1	13,298		
花王	159.6	155	877,300		日本ケミファ	12	13	5,304		大和工業	12.9	13.3	37,865		
第一工業製薬	16	25	8,275		ツムラ	18.6	19.3	54,908		東京製鋼	15	24	9,048		
三洋化成	20	20	16,920		日医工	14.3	14.6	26,864		大阪製鐵	3.7	4.2	7,156		
大日本塗料	46	43	8,600		キッセイ薬品工業	10.8	10.1	26,047		淀川製鋼所	42	9.3	24,728		
日本ペイントHOLD	51.1	47.2	158,356		生化学工業	12.1	12.4	19,120		東洋鋼板	16.5	17.3	5,138		
関西ペイント	71	67.9	146,799		栄研化学	5.8	6	16,692		丸一鋼管	17.2	20.1	68,038		
中国塗料	18	18	12,888		鳥居薬品	4.5	4.7	9,479		大同特殊鋼	99	101	46,056		
日本特殊塗料	2.8	6.2	6,925		JCRファーマ	5.2	5.4	13,597		日本高周波	—	6.4	4,608		
藤倉化成	13.1	14.5	8,482		東和薬品	3.3	3	12,420		日本冶金工	48.6	72.8	10,119		
太陽ホールディングス	5.1	4.6	15,755		富士製薬工業	1	2.7	6,901		山陽特殊製鋼	37	38	21,318		
DI C	236	23.7	73,233		沢井製薬	9.4	10.4	72,488		愛知製鋼	36	38	19,912		
サカタインクス	13.5	12.9	14,976		ゼリア新薬工業	12.7	13.1	21,064		日立金属	59.7	68.7	81,615		
東洋インキSCホールディング	58	57	25,479		第一三共	199.3	205.9	497,557		大平洋金属	40	48	13,680		
T&K TOKA	2.7	6.2	5,604		キョーリン製薬HD	15.9	16.1	35,307		新日本電工	37.1	40.4	6,585		
富士フィルムHLDGS	135.5	139	529,868		大幸薬品	3.1	4.6	7,162		栗本鉄工所	39	35	6,300		
資生堂	105.3	116.9	315,337		ダイト	3.5	3.9	8,521		三菱製鋼	47	47	7,708		
ライオン	69	71	104,157		大塚ホールディングス	126.9	131.7	596,074		非鉄金属 (0.9%)					
高砂香料	22	4.3	11,373		大正製薬HD	14.1	14.5	146,595		日本軽金属HD	161	145.9	31,514		
マンダム	6.3	5.8	25,520		ペプチドリウム	—	10.3	50,624		三井金属	170	161	33,327		
ミルボン	4.1	3.9	18,252		石油・石炭製品 (0.5%)					東邦亜鉛	39	43	13,459		
ファンケル	14.4	14.2	24,750		日本コープス工業	81.3	64.2	5,200		三菱マテリアル	370	378	107,352		
コーセー	9.7	9.9	97,812		昭和シェル石油	58.3	57.8	51,268		住友鉱山	163	167	217,100		
シーズ・ホールディングス	8.8	8.4	22,680		コスモ石油	169	—	—		DOWAホールディングス	71	80	54,960		
ポーラ・オルビスHD	6.1	6.2	54,932		ニチレキ	9	9	6,354		古河機金	105	103	16,171		
ノエビアホールディングス	4.4	4.1	12,976		東燃ゼネラル石油	88	90	86,310		大阪チタニウム	6.2	6.8	9,370		
エスエール	3.8	—	—		ユシロ化学	4.8	4.8	6,710		東邦チタニウム	10.9	11.9	8,663		
コニシ	5.1	10.6	12,349		ビービー・カストロール	—	4.3	5,396		UACJ	70	88	25,520		
長谷川香料	7.6	7.9	14,646		富士石油	17.9	19.5	5,889		古河電工	185	194	50,052		

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
近鉄グループHLDGS	千株	千株	千円				LINE	千株	千株	千円				マクノ・富士エHL DGS	千株	千株	千円			
562	577	242,340				野村総合研究所	—	9.5	41,895				10.8	10.9	12,088					
阪急阪神HLDGS	373	77.4	265,869			31.5	40.5	140,535				12.7	11.1	11,266						
129	130	63,830				インテックホールディングス	4.5	4.3	6,888				4.6	4.3	7,030					
128	128	90,624				フジ・メディア・HD	58.2	58.7	77,894				30.1	29.3	19,338					
神戸電鉄	28	27	9,990			オービック	19.3	19.9	103,679				5.5	5.3	6,444					
名古屋鉄道	194	209	111,188			ジャストシステム	10.2	12.9	11,055				10.6	11.8	34,833					
山陽電鉄	25	27	14,310			ヤフー	400.4	424.3	173,538				6.6	6.5	7,839					
日本通運	219	221	111,384			トレンドマイクロ	27.6	28.1	99,333				—	14.2	9,684					
ヤマトホールディングス	99.4	106	257,845			日本オラクル	8.8	9.6	57,984				8.6	9.3	19,213					
山丸	69	76	43,548			フューチャー	9.8	10.2	7,425				5.9	6.4	19,392					
丸全昭和運輸	24	24	8,760			CAC HOLDINGS	6.6	9.7	7,924				5.6	5.9	7,675					
センコー	26	27	18,387			オービックビジネスC	4	3.2	14,896				—	10.2	40,392					
トナミホールディングス	7	16	4,128			伊藤忠テクノソリューションズ	13.2	13.3	34,486				55.6	56.5	97,180					
ニッコンホールディングス	18.4	17.6	38,227			アイティフォー	14.8	24	13,896				4.6	4.8	20,424					
福山通運	32	34	20,468			大家商會	15.1	15.8	75,919				6.5	6.3	6,356					
セイノーホールディングス	43.7	40	43,840			サイボウズ	—	27.5	13,282				7.9	7.4	15,569					
神奈川中央交通	17	13	9,191			電通国際情報S	5.8	4.5	8,433				10.1	11.2	21,772					
日立物流	11.9	12.6	26,182			ウェザーニューズ	2.5	2.5	7,675				3	11.8	6,690					
丸和運輸機関	0.3	—	—			C I J	—	14.1	6,387				4.4	6.5	6,682					
海運業 (0.2%)						WOWOW	3.3	3.5	9,737				2	4.2	5,031					
日本郵船	479	507	94,302			フュージョンプार्टナー	1.6	—	—				18.1	16.6	9,412					
商船三井	298	283	65,939			イマジカ・ロボットHD	2.9	—	—				—	4.9	6,992					
川崎汽船	255	257	65,792			ネットワークシステムズ	25.1	26.6	18,779				4.1	4	16,020					
N S ユナイテッド海運	30	34	4,658			マーベラス	10.6	11.6	8,758				465.3	452.9	560,690					
飯野海運	34.3	34.9	12,773			エイベックス・グループHD	11.5	11.2	15,489				484.1	559.5	284,785					
空運業 (0.6%)						日本ユニシス	17.7	16.8	21,386				—	66	10,626					
ANAホールディングス	107.5	110.4	336,499			兼松エレクトロニクス	6.6	5.2	9,729				30.7	26	31,616					
倉庫・運輸関連業 (0.2%)	1,112	1,072	304,448			東京放送HD	34.4	33.7	49,471				5	4.7	6,669					
トランコム	1.9	2	11,680			日本テレビルLD S	51.2	51.9	85,790				62.3	62.1	147,363					
日新	31	29	8,497			朝日放送	1.4	—	—				17.4	13.2	4,224					
三菱倉庫	38	39	59,397			テレビ朝日HD	16	16	28,784				121	129	19,479					
三井倉庫HOLD	41	39	11,583			スカパーJ SATHD	48.9	46.7	22,135				470.2	520.7	699,560					
住友倉庫	43	35	18,340			テレビ東京HD	5.5	6.2	13,410				19	28	9,212					
渋沢倉庫	21	22	6,138			コネクシオ	6.7	6.7	9,011				19.4	19.5	74,490					
東陽倉庫	26	25	5,750			日本通信	25.6	46	8,234				9.6	8.5	6,927					
日本トランスシティ	20	18	6,372			日本電信電話	437.5	444	2,048,616				—	28	4,508					
安田倉庫	7.3	7.1	4,189			KDD I	568	569.3	1,746,043				30	2.5	11,975					
東洋埠頭	31	79	12,324			光通信	5	6.8	62,220				23.3	23.4	17,994					
組	65	64	56,896			N T T ドコモ	431.2	429.5	1,099,090				325.1	355.2	395,692					
キョーユー流通システム	0.9	2.9	6,594			エムティーアイ	5.5	10.6	6,646				20	19	8,075					
郵船ロジスティクス	6.2	6.7	6,586			GMOインターネット	19.9	22.2	29,015				426.9	431.9	917,355					
近鉄エクスプレス	5.2	11.1	14,407			カドカワ	14.3	18.3	25,107				19	18	9,270					
情報・通信業 (8.4%)						学研ホールディングス	32	28	8,456				15.8	16.3	29,454					
NECネットエスアイ	7.3	7	12,159			ゼンリン	9.7	8.4	14,439				26	29	7,627					
システナ	9.7	7.4	13,112			松竹	39	38	43,890				26	29	7,627					
デジタルアーツ	2.3	4.2	10,718			東宝	40	40.9	135,788				7.9	7.7	9,216					
新日鉄住金SOL	5.2	10.2	17,890			東映	23	22	17,622				5.7	6.1	13,212					
T I S	—	19.4	48,150			N T T データ	34.7	36.4	189,644				30	54	9,558					
I Tホールディングス	19.2	—	—			D T S	6.9	7.2	15,940				5.9	5.9	35,046					
電算システム	—	3.4	5,035			スクウェア・エニックス・HD	22	24.4	78,324				10.8	10.1	9,625					
グリー	34.9	36.3	22,360			シーイーシー	6.2	5.9	11,003				14	13	8,762					
コーエーテックモHD	13.9	14	26,236			カブコン	15.3	14.9	33,629				60	67	38,994					
三菱総合研究所	3.3	2.9	9,309			ジャストテック	8.7	10.7	10,946				37	36	4,968					
フィンテックス	3.2	—	—			S C S K	13.8	14.2	55,664				44	—	—					
K L a b	8.1	11	6,688			アイエス	9.7	10.1	11,524				17	15	9,615					
ポルトウイン・ピットル	3.2	9.1	7,562			T K C	5.9	5.8	17,179				15.4	15.2	14,835					
ネクソン	54.2	56.1	83,252			富士ソフト	8.7	9	24,723				13.5	12.8	9,587					
アイスタイル	1.8	11	8,404			N S D	15.7	13.1	20,684				19.6	18.7	39,681					
イチチーム	1.7	4.4	9,605			コナミホールディングス	23.4	26.1	99,832				19.6	20	37,100					
e n i s h	0.9	—	—			J B C Cホールディングス	10.4	10	6,640				14.2	10.9	5,831					
コプロラ	14.9	16.4	24,714			ミロク情報サービス	—	6.6	11,431				19	16	6,304					
オルトプラス	1.1	—	—			ソフトバンクグループ	295.6	327	2,117,979				14.5	15.2	11,901					
ブロードリーフ	5.3	7.8	8,572			卸売業 (4.2%)							15.7	17.5	32,847					
ハーツユナイテッドグループ	1.3	—	—			J A L U X	—	3	5,001				5.6	5.9	4,200					
ブイキューブ	1	—	—			あらた	4.1	3	6,813				9.9	9.1	28,346					
ディーガイア	6.6	6.2	8,785			フィールズ	2.3	4.7	5,978				8.6	7.7	7,869					
豆蔵ホールディングス	3.1	—	—			双日	383.8	366.7	92,775				4.6	3.6	8,254					
ガンホー・オンライン・エンター	—	133.3	32,125			アルフレッサホールディングス	65.5	71.4	151,153				9.4	9.6	8,448					
GMOペイメントゲートウェイ	5.4	5.2	24,830			横浜冷凍	17.5	15.7	15,700				10.3	10.4	10,452					
インターネットインテグリティ	9.9	9.9	18,572			アルゴニクス	4.4	5.3	7,186				7.3	7.7	24,293					
S R Aホールディングス	2.1	4.3	9,240			神戸物産	2	4.3	9,558				6.1	6	7,206					
朝日ネット	14.3	15	6,465			あいホールディングス	9.8	10.8	24,915				9.7	9.4	21,902					
g u m i	4.4	8.1	6,212			ダイワボウHD	6.7	5.8	13,514				3.2	—	—					
													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	コロナフイド	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
ズッケン	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
ジェコス	4.9	4.9	4,125	ユニー・ファミリマートHD	18.5	25.6006	173,572	千葉興業銀行	13.9	19	7,543
小売業 (4.8%)				木曾路	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
エービーシー・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	24,252	島忠	14	14.6	35,127	みちのく銀行	32	30	6,090
くらこポレション	3.8	3.6	16,884	チヨダ	6.9	6.8	16,401	ひくおかフィナンシャルG	227	246	102,582
キャンドゥ	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
バルグループHLDGS	3.7	3.7	8,558	リンガーハット	6.3	5.8	13,258	リンガーハット	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	コムリ	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	エイチ・ツー・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	バルコ	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	6.6	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	アクシアル リテイリング	5	4.8	15,480	三重銀行	39	28	5,796
ドット・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	ユニーグループ・HD	57.8	—	—	広島銀行	160	165	68,970
プロンコピリー	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	—	—
チムニー	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・レストランツ・ホールディングス	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
サマルグホールディングス	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
クスリのアオキ	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	ベルーナ	17.1	15.9	9,762	第三銀行	45	39	6,825
カッパ・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	コンコディア・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	あおぞら銀行	390	372	132,060	三井銀行	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	りそなホールディングス	655.7	673.8	292,429	東和銀行	87	91	8,008

銘柄	期首		当期末		評価額
	株数	株数	株数	株数	
	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		
いちよし証券	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 FH	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		
アクリーティブ	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キャピタルリソリューション	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		
三重交通グループHD	—	14.7	5,615		
日本商業開発	1	—	—		
アプラスコーポレーション	2.5	2.3	9,729		
ユニバーホールディングス	2.6	4.1	11,496		
日本管理センター	2.8	5.5	6,710		
オーブンハウス	8	8.9	20,203		
東急不動産HD	1.0	139.3	75,500		
飯田GHD	35.7	52.6	101,518		
パーク24	28.8	29	89,465		
三井不動産	29.6	305	633,332		
三菱地所	41.5	431	807,263		
平和不動産	13.4	12.2	16,616		

銘柄	期首		当期末		評価額
	株数	株数	株数	株数	
	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		
テーオーシー	20.9	23	17,733		
東京築地	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	72,572		
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		
アコーディア・ゴルフ	24.2	16.7	17,785		
タケエイ	8.1	9.3	7,412		
パソナグループ	3.5	7.4	5,705		
GCA	6	8.6	6,389		
エス・エム・エス	7.5	8.6	20,347		
テナホールディングス	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	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	—	—		
一体	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		
EPS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	—	—		
みらがホールディングス	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		
ファルコホールディングス	8.3	8.9	8,588		
ラウンドワン	19.1	20.8	14,851		
リゾントトラスト	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		当期末		評価額
	株数	株数	株数	株数	
	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		
リキャストホールディングス	4.8	8	6,704		
テックプロ・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		
リコグループ	2.2	2.4	37,032		
東祥	0.7	2.2	9,878		
イーチ・アイ・エス	10	10	26,040		
共立メンテナンス	3.8	4.7	30,315		
イチメンホールディングス	10.2	11.7	10,834		
建設技術研究所	4.8	5.7	5,130		
東京テアトル	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		
アサツー ディ・ケイ	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	株数・金額	株数・金額	株数・金額	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	TOPIX	百万円 208	百万円 —

(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 額	借 入 額
株 式	株 2,980,000 (1,418,700)	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1,418,700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		期末
	評価額	比率	
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
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

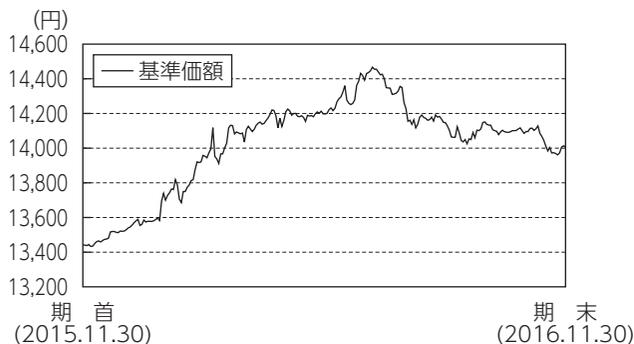
大和投資信託

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 (ベンチマーク)		公 社 債 組 入 比 率		債 券 先 物 比 率	
	円	%	総合指数	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くなったことや、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や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行ないました。

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

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

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

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(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	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	当 期			末			
	額面金額	評 価 額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	36,119,000	40,657,453	78.3	—	52.4	18.5	7.4
地方債証券	3,650,000	3,811,406	7.3	—	3.4	3.1	0.8
特殊債券(除く金融債券)	3,019,000	3,171,646	6.1	—	3.7	1.2	1.2
金融債券	200,000	200,916	0.4	—	—	—	0.4
普通社債券	3,200,000	3,308,223	6.4	—	1.6	3.8	1.0
合 計	46,188,000	51,149,645	98.5	—	61.2	26.6	10.8

(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)

区 分	当 期		末			
	銘	柄	年利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
			%	千円	千円	
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	120,974	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

区 分	当 期	銘 柄	年 利 率	未		
				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

区 分	当 期	銘 柄	年 利 率	未		
				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

区 分	当 期		未		
	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

区 分	当 期		未		
	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	名古屋市公債	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			未	
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		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	
	6 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	
	F143 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		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		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BK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			未	
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 AUST・NZ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FS	0.5720	100,000	100,743	2021/03/18	
	9 三菱UFJ信託BK劣	1.6800	100,000	106,667	2021/04/28	
	11 セブアンロードアイ	0.5140	100,000	101,819	2022/06/20	
	11 三菱UFJ信託BK	1.3600	100,000	106,322	2022/06/27	
	372 中国電力	1.2040	100,000	105,980	2022/08/25	
	4 JX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UFJFG 劣後	0.9400	100,000	103,114	2024/06/26	
種別	銘柄数					
小計	金額		3,200,000	3,308,223		
合計	銘柄数		361銘柄			
合計	金額		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-1'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

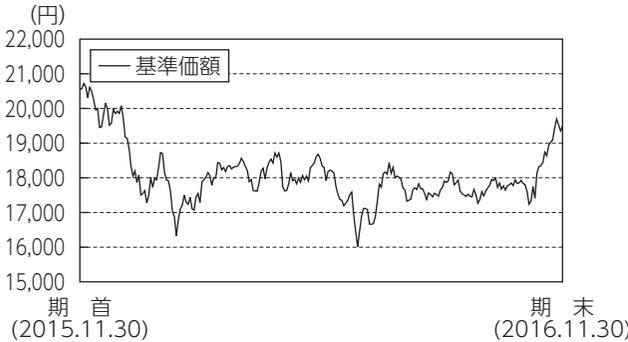
大和投資信託

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



《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知られた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 & 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。

◆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。

年 月 日	基準価額		MSCIコクサイ指数(円ベース)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	騰落率	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、知的財産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。

■ 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	百株 6,789.3 (△)	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
	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
	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
	百株 3,343 (182.29)	千香港ドル 5,446 ()	百株 70	千香港ドル 639
	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
	百株 313 ()	千ニューゼaland・ドル 112 ()	百株 -	千ニューゼaland・ドル -
	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
	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
	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
	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
	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	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 -
	百株 42.5 ()	千ユーロ 350 ()	百株 -	千ユーロ -
	百株 454 (15.3)	千ユーロ 886 (△ 122)	百株 27	千ユーロ 49
	百株 32 (△ 23)	千ユーロ 249 (△ 7)	百株 14	千ユーロ 107
	百株 224 ()	千ユーロ 112 (△ 21)	百株 -	千ユーロ -
	百株 562 (35.51)	千ユーロ 2,171 (△ 69)	百株 661	千ユーロ 347
	百株 540.5 ()	千ユーロ 2,206 (△ 47)	百株 64.5	千ユーロ 232
	百株 1,638.5 (869.43)	千ユーロ 810 (△ 21)	百株 41	千ユーロ 57
	百株 2,503 (△ 78.16)	千ユーロ 536 (△ 45)	百株 942.65	千ユーロ 183
	百株 621.5 ()	千ユーロ 473 ()	百株 5	千ユーロ 19
	百株 11 ()	千ユーロ 28 (△ 2)	百株 -	千ユーロ -
	百株 21 ()	千ユーロ 30 (156)	百株 -	千ユーロ -
	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	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 -)	千口 7.8 (-)	千カナダ・ドル (188 -)	千口 (-)	千カナダ・ドル (-)
	カナダ	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 (-)	千口 2.5 (-)	千香港ドル (131 -)	千口 (-)	千香港ドル (-)
	オーストラリア	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 (-)	千口 5.5 (-)	千イギリス・ポンド (34 -)	千口 (-)	千イギリス・ポンド (-)
	香港	千口 1.46 (-)	千ユーロ (115 0)	千口 (-)	千ユーロ (-)	千口 (-)	千ユーロ (-)	千口 (-)	千ユーロ (-)
	シンガポール								
	イギリス								
	ユーロ (フランス)								

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

(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	新規買付額	決 済 額	新規買付額	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 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
株 式

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

当					期				
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。

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		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)	百株	百株	千円	千円			
BROADBRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	—	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 INFO SERV	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 IN	23.7	135	740	83,229			金融

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)	百株	百株	千円	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
BENTON 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	35,626			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	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	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	
			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 IN	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		
FREEMONT-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 HOLDIN	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		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
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		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
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		当		期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
XYLEM INC	38	42	215	24,240	千ドル	千円	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 HANNIFIN 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		当		期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
EDISON INTERNATIONAL	69	75	533	59,990	千ドル	千円	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
SYNOPSIS 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	52	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		期末		業種等
	株数	株数	評価価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
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		期末		業種等
	株数	株数	評価価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
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	58,656	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		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
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		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
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	67,034.73	71,134.09	445,578	50,091,912	—	—	株数、金額 銘柄数<比率> <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	
			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		
VERESEN 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 COR	-	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 MANAGE-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	
			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		
ARC LTD - CLASS I	-	17	73	6,130	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 銘柄数<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)	株数	株数	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	金融		
ORIGIN ENERGY LTD	364	414	250	21,039	エネルギー		
AMCOR LIMITED	267	267	387	32,597	素材		
AMCORON 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		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千円	千円			
INCITEC PIVOT LTD	456	456	147	12,392	素材		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	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-COI	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 54銘柄	18,405.06 63銘柄	-25,803	2,171,113	< 2.7% >		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円			
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	300	330	2,413	35,002	公益事業		
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	520	550	2,068	29,986	一般消費財・サービス		
MTR CORP	320	345	1,338	19,409	資本財・サービス		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	380	350	3,514	50,953	不動産		
SINO LAND CO	880	880	1,022	14,827	不動産		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	586.69	631.69	5,963	86,465	資本財・サービス		
WHARF HOLDINGS LTD	290	320	1,760	25,520	不動産		
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	125	125	963	13,974	不動産		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			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		
HONG 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 HDG	210	210	582	8,449	一般消費財・サービス		
NWWS 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 通貨計	株数、金額 35銘柄	21,468.06 38銘柄	-68,937	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	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	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	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)	株数	株数	千円	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	1,091.89 4銘柄	1,404.89 6銘柄	718	57,646			< 0.1% >
(イギリス)	株数	株数	千円	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		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
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		
SEVEN 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		
SHTEAD 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	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
COCA-COLA HBC AG-DI	百株	百株	44	44	73	10,351	生活必需品
WILLIAM HILL PLC	192	192	58	58	8,147	14,717	一般消費財・サービス
BURBERRY GROUP PLC	95.89	104.89	147	147	20,743	20,743	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP AG	50.73	44.77	148	148	20,915	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	84	11,816	11,816	資本財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC	53	59	80	80	11,353	11,353	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	35	38	123	123	17,346	17,346	資本財・サービス
ITV PLC	825	868	148	148	20,872	20,872	一般消費財・サービス
PETROFAC LTD	56	56	43	43	6,056	6,056	エネルギー
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	66.49	75.49	209	209	29,434	29,434	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	849	1,000	1,949	1,949	273,756	273,756	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	533.81	881.18	1,790	1,790	251,439	251,439	エネルギー
MEGGITT PLC	177	177	83	83	11,719	11,719	資本財・サービス
G4S PLC	346	346	82	82	11,654	11,654	資本財・サービス
COBHAM PLC	256	386	63	63	8,935	8,935	資本財・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	33	55	55	7,736	7,736	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	—	52	98	98	13,870	13,870	金融
INVESTEC PLC	123	145	75	75	10,621	10,621	金融
ANTOFAGASTA PLC	86	86	60	60	8,455	8,455	素材
STANDARD LIFE PLC	424.63	454.63	158	158	22,209	22,209	金融
EXPERIAN PLC	209.54	230.54	345	345	48,572	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	5,589.335	< 7.1% >	
(イスラエル)	百株	百株	千円	千円			
AZRIELI GROUP LTD	—	10	164	164	4,829	4,829	不動産
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	564	564	398	398	11,681	11,681	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD	140	140	201	201	5,910	5,910	素材
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	189	—	—	—	—	—	ヘルスケア
BANK HAPOALIM BM	265	265	613	613	17,987	17,987	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	376	376	583	583	17,120	17,120	金融
NICE LTD	17	17	430	430	12,615	12,615	情報技術
イスラエル・シケル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,551 6銘柄	1,372 6銘柄	2,392	70,144	< 0.1% >	
(スイス)	百株	百株	千円	千円			
DUFREY AG-REG	9	10.5	130	130	14,501	14,501	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	802	860	1,357	1,357	150,880	150,880	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	—	2	101	101	11,288	11,288	素材
ADECCO GROUP AG-REG	37	40	250	250	27,777	27,777	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSEIN	153.5	165	3,735	3,735	415,062	415,062	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	8	8	51	51	5,671	5,671	金融
SIKA AG-BR	0.54	0.54	263	263	29,327	29,327	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.02	117	117	13,015	13,015	生活必需品
ABB LTD-REG	483	439	907	907	100,871	100,871	資本財・サービス
ARYZTA AG	21	21	92	92	10,259	10,259	生活必需品
TRANSOCEAN LTD	84.5	—	—	—	—	—	エネルギー
SWISS RE AG	78	78	726	726	80,685	80,685	金融
NESTLE SA-REG	699.5	727	4,965	4,965	551,706	551,706	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3.5	4.2	209	209	23,251	23,251	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	10	179	179	19,966	19,966	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	341.2	435.2	585	585	65,085	65,085	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	52	52	231	231	25,716	25,716	金融
SULZER AG-REG	6.5	—	—	—	—	—	資本財・サービス
SGS SA-REG	1.3	1.3	262	262	29,220	29,220	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	—	5	88	88	9,838	9,838	資本財・サービス
GALENICA AG-REG	—	0.9	95	95	10,619	10,619	ヘルスケア

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
SWATCH GROUP AG/THE-BR	百株	百株	7	7.5	221	24,649	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	33.32	35.12	93	103	103,407	103,407	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	12	12	149	149	16,573	16,573	金融
NOVARTIS AG-REG	496.5	522	3,656	406,285	406,285	ヘルスケア	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	—	0.5	60	6,744	6,744	生活必需品	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	114.5	123.5	805	89,467	89,467	一般消費財・サービス	
SWISSCOM AG-REG	5.5	5.9	255	28,418	28,418	電気通信サービス	
GEBERIT AG-REG	8	9	360	40,069	40,069	資本財・サービス	
GIVAUDAN-REG	2.1	2.2	400	44,488	44,488	素材	
ACTELION LTD-REG	23	22.5	470	52,249	52,249	ヘルスケア	
SYNGENTA AG-REG	20.12	21.62	829	92,220	92,220	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	13	13	160	17,795	17,795	ヘルスケア	
LONZA GROUP AG-REG	13	13	234	26,100	26,100	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	11	11	63	7,070	7,070	一般消費財・サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	95.4	108.4	569	63,292	63,292	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	8	8	224	24,897	24,897	金融	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	12.5	12.5	165	18,374	18,374	資本財・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	14	16	133	14,870	14,870	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	—	0.23	116	12,994	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	2,684,721	< 3.4% >	
(デンマーク)	百株	百株	千円	千円			
NOVO NORDISK A/S-B	428	450	10,354	166,603	166,603	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S	152.5	163.5	3,368	54,192	54,192	金融	
ISS A/S	—	39	947	15,242	15,242	資本財・サービス	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.95	0.95	842	13,550	13,550	資本財・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52	52	2,445	39,340	39,340	資本財・サービス	
TDC A/S	193	193	690	11,117	11,117	電気通信サービス	
CARLSBERG AS-B	24.5	24.5	1,460	23,494	23,494	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	55	55	1,310	21,088	21,088	素材	
COLOPLAST-B	25	28	1,236	19,890	19,890	ヘルスケア	
DSV A/S	42	46	1,444	23,247	23,247	資本財・サービス	
WILLIAM DEMANT HOLDING	6.75	33.75	391	6,299	6,299	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1.6	1.6	1,496	24,083	24,083	資本財・サービス	
PANDORA A/S	25	26.5	2,232	35,922	35,922	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	—	23.5	933	15,026	15,026	素材	
GENMAB A/S	—	13	1,608	25,874	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	494,974	< 0.6% >	
(ノルウェー)	百株	百株	千円	千円			
NORSK HYDRO ASA	299	334	1,352	17,828	17,828	素材	
DNB ASA	211.5	225.5	2,753	36,289	36,289	金融	
ORKLA ASA	190.5	190.5	1,458	19,220	19,220	生活必需品	
TELENOR ASA	158	178	2,255	29,724	29,724	電気通信サービス	
STATOIL ASA	241.73	261.73	3,656	48,190	48,190	エネルギー	
SCHIBSTED ASA-CL A	—	15	275	3,635	3,635	一般消費財・サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	37.6	41.6	1,321	17,419	17,419	素材	
MARINE HARVEST	—	87	1,345	17,738	17,738	生活必需品	
GIJENSIDIGE FORSKRING ASA	39.5	48.5	671	8,853	8,853	金融	
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	18	315	4,163	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	203,063	< 0.3% >	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
(スウェーデン)	百株	百株	千ユーロ	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		
MILICOM 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	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 29銘柄数<比率>	株数、金額 30銘柄数	70,619	865,083			
				< 1.1% >			
(ユーロ (アイルランド))	百株	百株	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 3銘柄数<比率>	株数、金額 4銘柄数	1,184	141,808			
				< 0.2% >			
(ユーロ (オランダ))	百株	百株	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		
BOSKALING 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	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
KONINKLIJKE KPN NV	百株	百株	千ユーロ	千円			
ASML HOLDING NV	684.5	782.5	212	25,383	電気通信サービス		
TNT EXPRESS NV	74.3	86.8	846	101,354	情報技術		
ABN AMRO GROUP NV-CVA	101.95	-	-	-	その他		
VOPAK	-	54	107	12,817	金融		
RANDSTAD HOLDING NV	20	16	69	8,285	エネルギー		
HEINEKEN HOLDING NV	26.5	30	144	17,272	資本財・サービス		
GEMALTO	23	23	152	18,225	生活必需品		
OCI NV	17	20	97	11,718	情報技術		
ALTICE NV - A	23	-	-	-	素材		
ALTICE NV - B	57	89	142	17,055	一般消費財・サービス		
AIRBUS GROUP SE	19	29	46	5,581	一般消費財・サービス		
CNH INDUSTRIAL NV	128	136	821	98,375	資本財・サービス		
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	209	243	195	23,356	資本財・サービス		
FERRARI NV	193.5	193.5	139	16,699	一般消費財・サービス		
	-	28.35	146	17,595	一般消費財・サービス		
国小計	株数、金額 26銘柄数<比率>	株数、金額 26銘柄数	4,125.57	4,567.87	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 10銘柄数<比率>	株数、金額 10銘柄数	440.9	435.9	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 4銘柄数<比率>	株数、金額 4銘柄数	398	622	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	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	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		
LVMH 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		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	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 LICHT 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		
BRENNTAG 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-PRF	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 &	48.5	50.5	373	44,731	ヘルスケア		
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	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		当 期		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	128	165	59	7,131			電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	—	12	82	9,835			一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD	14	16.5	89	10,730			一般消費財・サービス
VONOVIA SE	104	109	336	40,237			不動産
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)	株数、金額 銘柄数<比率>	株 数	株 数	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)	株数、金額 銘柄数<比率>	株 数	株 数	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	574.73	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)	株数、金額 銘柄数<比率>	株 数	株 数	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		当 期		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
POSTE ITALIANE SPA	—	118	67	8,135			金融
ENI SPA	544	598	757	90,621			エネルギー
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	112.25	95.25	116	13,886			資本財・サービス
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	508.15	—	—	—			金融
ENEL SPA	1,515	1,778.34	673	80,676			公益事業
SNAM SPA	444	582	204	24,480			エネルギー
LUXOTTICA GROUP SPA	37	37	179	21,484			一般消費財・サービス
UBI BANCA SPA	196	—	—	—			金融
TERNA SPA	322	354	142	17,110			公益事業
ENEL GREEN POWER SPA	404	—	—	—			その他
EXOR SPA	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)	株数、金額 銘柄数<比率>	株 数	株 数	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			公益事業
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)	株数、金額 銘柄数<比率>	株 数	株 数	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 INTERNATIONA	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)	株数、金額 銘柄数<比率>	株 数	株 数	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	
	□ 数	□ 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千アメリカ・ドル	千円		
(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		
HOST HOTELS & 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	- -	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	
	□ 数	□ 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千オーストラリア・ドル	千円		
VICINITY CENTRES	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		
GECINA 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。

外国株式インデックスマザーファンド

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

項目	当期		比率
	評価額	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	期末
(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	
次期繰越増益金	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 エマージンググラス (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-1'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
(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) 当期増益金(A+B+C+D)	△ 3,818,534,181
(F) 前期繰越増益金	41,029,358,109
(G) 解約差増益金	△ 2,818,377,481
(H) 追加信託差増益金	4,074,175,918
(I) 合計(E+F+G+H)	38,466,622,365
次期繰越増益金(I)	38,466,622,365

- (注1) 解約差増益金とは、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) 追加信託差増益金とは、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

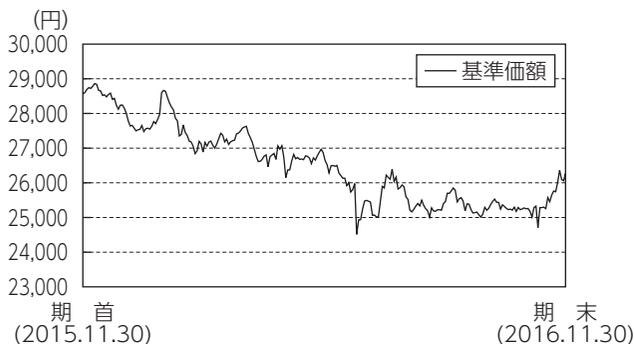
大和投資信託

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	%	円	%		%	%
(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10.00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と金利が上昇し、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 (—)
	国	メキシコ 国債証券	千メキシコ・ペソ 46,902
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				期 付			
買 銘	柄	付 金 額	千円	売 銘	柄	付 金 額	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 区 分	額 面 金 額	当 期			未 期				
		外 貨 建 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 5 年 以 上	間 別 2 年 以 上	組 入 比 率	2 年 未 満
アメリカ	千アメリカ・ドル 590,540	千アメリカ・ドル 599,940	千円 67,445,295	43.5%	%	%	%	%	%
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	0.5	
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	0.2	
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	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	0.4	
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	0.0	
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	0.1	
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	0.1	
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	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	0.1	
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	0.1	
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	0.3	
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	0.2	
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	0.9	
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	0.9	
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	0.6	
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 105,258	千ユーロ 121,214	14,509,366	9.4	—	5.6	2.9	0.9	
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	0.0	

作成期 区分	当				期 末				
	額面金額	評価額		組入比率	うちB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
	外貨建金額	千ユーロ	千円			%	5年以上	2年以上	2年未満
ユーロ (オーストリア)	15,749	19,264	2,305,937	1.5	—	0.9	0.4	0.1	
ユーロ (小計)	429,990	509,542	60,992,290	39.4	—	24.1	11.3	4.0	
合計	—	—	152,458,096	98.4	—	51.4	33.2	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	期 末		償還年月日	
				額面金額	評価額		
				千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,686	1,740	195,662	2017/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,839	3,957	444,847	2018/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	2,960	3,084	346,709	2018/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.0000	3,173	3,333	374,808	2018/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,488	2,615	294,024	2018/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,161	3,270	367,630	2019/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,096	3,238	364,038	2019/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	2,621	2,784	313,021	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,020	4,256	478,461	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,280	4,573	514,198	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,073	3,278	368,568	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,854	2,960	332,827	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,372	2,394	269,190	2017/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,509	4,679	526,027	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	883	895	100,634	2017/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	924	941	105,884	2017/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	255	259	29,224	2018/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,076	4,397	494,377	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,234	1,261	141,836	2018/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,300	1,332	149,827	2018/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	260	266	29,906	2018/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,702	303,763	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,322	1,349	151,665	2018/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,065	1,088	122,313	2018/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,341	1,368	153,833	2018/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,570	288,954	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,444	3,469	390,078	2018/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,835	2,849	320,377	2018/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,320	1,336	150,237	2018/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,169	243,911	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,165	2,176	244,691	2018/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,861	1,870	210,316	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,426	1,429	160,673	2019/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,244	364,790	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,843	1,851	208,176	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	300	302	33,974	2019/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	559	559	62,913	2019/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,436	273,955	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,385	2,378	267,440	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,368	1,359	152,810	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,784	1,765	198,471	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,497	280,723	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,872	1,856	208,756	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,215	2,195	246,831	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,648	2,646	297,488	2017/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	884	882	99,165	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,168	3,099	348,464	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	2,336	2,330	262,016	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,353	1,338	150,522	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	1,913	1,910	214,739	2017/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,894	1,879	211,258	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,153	2,151	241,916	2018/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,366	1,364	153,415	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,850	3,840	431,765	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	3,447	3,439	386,616	2018/02/28

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
					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	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 償 還 金 額			償 還 年 月 日
					評 価 金 額	外 貨 換 算 金 額	千 円	
			%	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

当		期				末			償還年月日							
区	分	銘	柄	種	類	年	利	率		額	面	金	額	評	価	額
									千	ア	メ	リ	カ	・	ド	ル
									千	ア	メ	リ	カ	・	ド	ル
									千	ア	メ	リ	カ	・	ド	ル
		United States Treasury Note/Bond	国	債	証	券	2.1250	%	2,492	2,505	2,816.38	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	237銘柄							590,540	599,940	67,445,294					
	金	額							千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ		Canada Government International Bond	国	債	証	券	2.7500		325	389	32,602	2064/12/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	8.0000		386	623	52,150	2027/06/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	5.7500		983	1,419	118,747	2029/06/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	5.7500		1,127	1,722	144,165	2033/06/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	5.0000		1,192	1,768	147,961	2037/06/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	4.2500		969	1,020	85,417	2018/06/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	3.7500		1,524	1,639	137,169	2019/06/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	4.0000		1,413	1,913	160,140	2041/06/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	3.5000		1,476	1,612	134,893	2020/06/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	3.2500		956	1,053	88,138	2021/06/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	2.7500		1,351	1,471	123,152	2022/06/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	3.5000		1,491	1,929	161,493	2045/12/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	1.5000		1,253	1,276	106,794	2023/06/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	1.2500		1,265	1,274	106,657	2018/03/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	1.2500		1,021	1,031	86,307	2018/09/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	2.5000		1,405	1,524	127,547	2024/06/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	1.7500		853	873	73,071	2019/03/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	1.7500		1,627	1,671	139,894	2019/09/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	2.7500		847	972	81,409	2048/12/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	2.2500		1,156	1,232	103,104	2025/06/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	1.5000		829	847	70,905	2020/03/01				
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国	債	証	券	1.2500		1,772	1,784	149,363	2018/02/01				

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 評 価 額			償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額	
					千 カ ナ ダ ・ ド ル	千 カ ナ ダ ・ ド ル		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	931	927	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	32銘柄		34,684	38,441	3,216,825		
オーストラリア	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	21銘柄		34,514	37,263	3,135,370		
シンガポール	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	19銘柄		7,037	7,286	575,419		
イギリス	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

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	期末			償還年月日
					評価額		換算金額	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
	United Kingdom Gilt	国債証券	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	2036/03/07	
	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	2022/03/07	
	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	銘柄数 金額	39銘柄		62,812	78,823	11,071,541		
スイス				千スイス・フラン	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	銘柄数 金額	6銘柄						
デンマーク				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ			
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	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	銘柄数 金額	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	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	銘柄数 金額	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	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	銘柄数 金額	7銘柄		47,400	55,521	680,141		

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%	千メキシコ・ペソ 15,647	千メキシコ・ペソ 14,937	千円 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 金額	17銘柄		219,416	225,977	1,231,577	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2400	千マレーシア・リンギット 1,210	千マレーシア・リンギット 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 金額	33銘柄		27,216	26,495	667,167	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	千南アフリカ・ランド 4,178	千南アフリカ・ランド 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

当		期			未		償還年月日																											
区	分	銘	柄	種	類	年		利	率	額	面	金	額	評	価	額																		
													外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額											
													千	南	ア	フリ	カ	・	ラ	ン	ド	千	南	ア	フリ	カ	・	ラ	ン	ド	千	円		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国	債	証	券	8.8750			3,166		2,957									23,954										2035/02/28		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国	債	証	券	9.0000			1,579		1,472									11,930										2040/01/31		
通貨小計	銘	柄	数								104,423		94,587									766,157												
			15								千	ポ	ー	ラ	ン	ド	・	ス	ロ	チ	千	ポ	ー	ラ	ン	ド	・	ス	ロ	チ				
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								31,114		31,602									852,954												
			15								千	ユ	ー	ロ	千	ユ	ー	ロ																
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								8,336		9,775									1,170,103												
			12								千	ユ	ー	ロ	千	ユ	ー	ロ																
ユーロ (オランダ)		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	7.5000			548		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																											

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	評 価 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,706	2,611	312,540	2028/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,839	339,911	2025/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	1,377	1,694	202,799	2022/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	966	1,026	122,885	2018/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	1,121	1,242	148,706	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	826	98,910	2019/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	685	1,056	126,519	2023/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,225	3,302	395,282	2025/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,623	4,066	486,746	2029/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,507	4,227	506,029	2032/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,709	4,305	515,370	2035/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,075	3,438	411,565	2019/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,564	2,612	312,730	2055/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,230	3,809	456,500	2021/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,424	3,663	438,478	2038/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,697	4,754	569,112	2023/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,931	3,125	374,083	2018/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,567	2,809	336,319	2018/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,484	4,076	487,923	2041/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,263	3,674	439,891	2019/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,380	3,837	459,403	2020/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,017	1,746	209,039	2060/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,981	476,617	2026/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,113	3,466	414,893	2020/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,550	4,158	497,726	2021/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,480	4,077	488,057	2022/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,099	3,735	447,199	2027/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	3,063	366,724	2022/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,114	2,167	259,473	2018/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,088	2,917	349,277	2045/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,712	444,401	2023/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,920	1,983	237,463	2018/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,086	3,549	424,891	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,764	1,836	219,776	2019/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,787	3,332	398,856	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,799	3,110	372,293	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,322	2,394	286,576	2019/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,792	2,803	335,612	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,070	3,117	373,127	2020/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,335	1,346	161,223	2018/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,101	2,181	261,151	2025/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,193	2,244	268,718	2020/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,020	2,145	256,831	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,592	1,614	193,295	2019/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,737	2,700	323,196	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	879	871	104,333	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	257	255	30,571	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,170	2,194	262,660	2021/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,000	956	114,455	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	1,129	135,222	2024/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,067	1,764	211,170	2027/07/04	

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
					評 価			
					外 貨 建 金 額	千 円	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,157	258,272	2028/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,426	170,712	2028/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,663	199,076	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,443	292,507	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	3,009	360,213	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,071	3,364	402,736	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	2,120	253,870	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,798	1,894	226,743	2018/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,211	2,390	286,093	2018/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,399	2,605	311,896	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	2,682	2,938	351,793	2019/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,481	2,757	330,079	2019/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,075	2,331	279,106	2020/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,928	2,183	261,380	2020/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,374	2,146	256,990	2042/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,444	1,603	191,955	2020/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,631	315,047	2021/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,968	235,598	2021/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,602	191,824	2021/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,707	1,921	229,954	2022/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,489	297,962	2022/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,728	2,429	290,806	2044/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,821	218,045	2022/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,568	187,757	2023/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	2,025	242,474	2023/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,839	220,200	2023/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,778	212,917	2024/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,709	2,431	291,001	2046/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,789	214,251	2024/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,673	200,316	2024/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,394	2,497	298,989	2025/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,034	2,200	263,424	2025/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,168	2,238	267,941	2026/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,700	1,663	199,086	2026/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	733	739	88,501	2017/12/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	747	754	90,354	2018/03/16	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,500	1,518	181,740	2018/06/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	700	709	84,957	2018/09/14	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,209	144,771	2018/02/23	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,392	1,412	169,023	2018/04/13	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,209	1,249	149,578	2018/10/12	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,438	1,495	178,962	2019/02/22	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,113	1,146	137,245	2019/04/12	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,151	1,183	141,679	2019/10/11	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,731	1,770	211,972	2020/04/17	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,448	1,496	179,177	2020/10/16	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,578	1,615	193,319	2021/04/09	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,200	1,227	146,873	2021/10/08	
国小計	銘柄数 金額	50銘柄		78,396	94,031	11,255,580		
ユーロ (スペイン)				千ユーロ	千ユーロ			
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,832	2,677	320,460	2029/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,735	1,746	209,097	2017/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,745	1,779	212,989	2025/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,552	1,556	186,368	2030/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	260	261	31,277	2018/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,792	1,898	227,241	2025/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1500	1,250	1,288	154,273	2020/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,802	215,802	2026/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,172	1,175	140,721	2019/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,067	1,077	129,032	2021/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	852	879	105,299	2046/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	400	430	51,527	2066/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,230	1,204	144,178	2026/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	2,965	355,000	2032/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,654	2,148	257,145	2037/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,428	2,036	243,820	2040/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1000	2,206	2,357	282,135	2018/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	2,111	252,774	2024/01/31	

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	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6000	2,382	2,659	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	37銘柄		59,673	69,975	8,376,016	
ユーロ (イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	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

区分	銘柄	種類	利率	額面金額	期末時価			償還年月日
					外貨	建金	邦貨換算金額	
			%	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	銘柄数 金額	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	432	445	53,371	2020/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	411	49,285	2031/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	292	35,065	2025/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	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	銘柄数 金額	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	527	539	64,592	2019/10/18	
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	939	112,451	2025/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	576	588	70,442	2026/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	234	245	29,375	2047/02/20	
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	985	1,575	188,607	2027/07/15	
	Austria Government Bond	国債証券	4.6500	1,066	1,131	135,386	2018/01/15	
	Austria Government Bond	国債証券	3.9000	1,248	1,446	173,136	2020/07/15	
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,583	189,521	2021/09/15	
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,073	1,692	202,604	2037/03/15	
	Austria Government Bond	国債証券	4.3500	989	1,102	131,978	2019/03/15	
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	675	953	114,130	2026/03/15	
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	963	115,327	2022/04/20	
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	1,056	126,485	2022/11/22	
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	318	574	68,743	2062/01/26	
	Austria Government Bond	国債証券	1.9500	738	787	94,228	2019/06/18	
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	907	108,628	2044/06/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,076	128,848	2023/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	501	620	74,222	2034/05/23	
	Austria Government Bond	国債証券	1.1500	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	銘柄数 金額	20銘柄		15,749	19,264	2,305,937		
通貨小計	銘柄数 金額	287銘柄		429,990	509,542	60,992,290		
合計	銘柄数 金額	742銘柄				152,458,096		

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

項目	当期		比率
	評価額	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
(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-e 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
(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。