

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合		
信託期間	無期限		
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないま		
主要投資対象	ベビーファンド	下記の各マザーファンドの受益証券	
	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。）	
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式（預託証書を含みます。）	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）	
	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）	
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債	
ダイワ・マネー・マザーファンド	本邦通貨表示の公社債		
ベビーファンドの運用方法	①主として、マザーファンドを通じて内外の株式、債券、リート（ＲＥＩＴ）に投資するとともに、短期金融資産に投資を行ない、中長期的に安定した信託財産の成長をめざして運用を行ないます。		
	②マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2050年に近づくに従って株式等の組み入れを漸減させ、債券の組み入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ないます。		
	当初設定時の基本配分比率		
	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券	…信託財産の純資産総額の48%	
	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券	…信託財産の純資産総額の32%	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券	…信託財産の純資産総額の5%	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券	…信託財産の純資産総額の5%	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券	…信託財産の純資産総額の5%	
	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券	…信託財産の純資産総額の5%	
	③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。		
④2050年の決算日以降は、ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドおよびダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券のほか短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用をめざします。			
組入制限	株式組入上限比率		
	トピックス・インデックス・マザーファンド	無制限	
	外国株式インデックスマザーファンド	純資産総額の10%以下	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	純資産総額の30%以下	
	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	純資産総額の30%以下	
	外国債券インデックスマザーファンド	純資産総額の30%以下	
	ダイワ・マネー・マザーファンド	純資産総額の30%以下	
	投資信託証券組入上限比率	無制限	
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	無制限		
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	無制限		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

DCダイワ・ターゲットイヤー2050

運用報告書（全体版）
第1期
（決算日 2016年12月19日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「DCダイワ・ターゲットイヤー2050」は、このたび、第1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託
Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）
TEL 0120-106212
（営業日の9：00～17：00）
<http://www.daiwa-am.co.jp/>

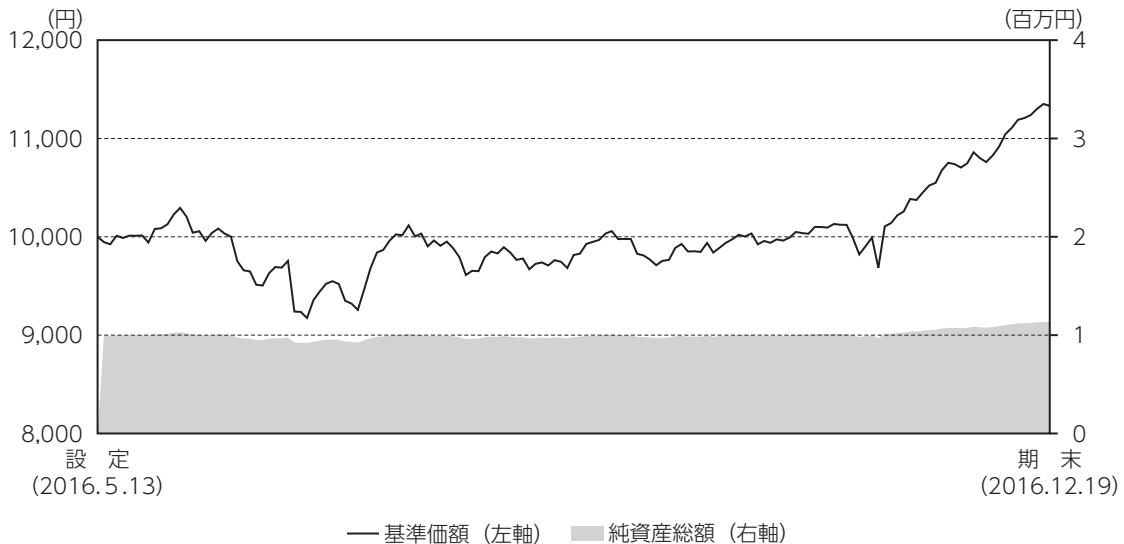
設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			株 式 組入比率	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	不 動 産 投信指数 先物比率	純 資 産 総 額
	税 込 分配金	期 中 騰落率								
1 期末(2016年12月19日)	円 11,332	円 0	% 13.3	% 81.5	% 0.5	% 8.1	% －	% 9.3	% 0.0	百万円 1

(注 1) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注 2) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。
(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。
(注 5) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

《運用経過》

基準価額等の推移について



■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：11,332円

騰落率：13.3%

■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	17.0%
外国株式インデックスマザーファンド	16.8%
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	△4.2%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	4.5%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	△2.1%
外国債券インデックスマザーファンド	1.3%

（注）騰落率は2016年5月12日から期末までの期間で算出。

■基準価額の主な変動要因

内外の株式、債券、リートに投資した結果、内外の株式が上昇したことが寄与し、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

DCダイワ・ターゲットイヤー2050

年 月 日	基 準	価 額	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	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
		騰 落 率						
(設定) 2016年 5 月13日	円	%	%	%	%	%	%	%
	10,000	—	—	—	—	—	—	—
5 月末	10,294	2.9	78.1	1.3	9.5	—	10.5	0.1
6 月末	9,446	△ 5.5	76.2	1.3	9.7	—	10.8	0.1
7 月末	9,951	△ 0.5	78.7	0.8	9.1	—	10.6	0.1
8 月末	9,928	△ 0.7	78.9	0.9	9.0	—	10.3	0.0
9 月末	9,840	△ 1.6	78.8	1.2	9.0	—	10.3	0.1
10月末	10,123	1.2	79.8	1.1	8.7	—	9.6	0.0
11月末	10,748	7.5	80.6	0.9	8.3	—	9.5	0.0
(期末) 2016年12月19日	11,332	13.3	81.5	0.5	8.1	—	9.3	0.0

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、設定時より、英国でのE U（欧州連合）残留の是非を問う国民投票への見方から株価は上下動しました。2016年6月は、英国の国民投票でE U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、上昇に転じました。

○海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は、設定時より、ギリシャへの追加融資の合意やイタリアの銀行業界再編への期待などを背景に堅調に推移しましたが、2016年6月下旬に英国の国民投票でE U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反発し、米国企業の良い決算内容などを受けて上昇基調となりましたが、米国の利上げ観測が台頭すると一进一退の展開となりました。11月に入ると、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことで新政権の政策への期待から上昇し、期を通じては上昇して期末を迎えました。

○国内リート市況

国内リート市況は、設定時より、国内景況感の先行き不透明感などから緩やかに下落しましたが、2016年6月下旬に、E U残留か離脱かを問う英国の国民投票が離脱派が多数となったことを受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、一時調整を余儀なくされました。しかし、長期金利の低下がさらに進んだことを受けて、下落前とほぼ同水準まで値を戻しました。7月末以降は、日銀政策決定会合において国内リーートの追加買入れがなかったことや米国の金利引き上げ観測の高まり、国内長期金利の上昇などが嫌気されて緩やかな下落基調が続きました。11月の米国大統領選挙後は、米国金利の上昇に伴う国内長期金利の上昇を受けて下落しましたが、日銀が指値オペを実施して過度な金利上昇を抑制する姿勢を示したことなどを受けて上昇に転じ、期末を迎えました。

○海外リート市況

海外リート市況は、設定時より、世界的な長期金利の低下を受けて堅調でした。しかし2016年8月からは、米国を中心に長期金利が上昇に転じた影響でリートは売られました。

米国では、設定時よりしばらくは米国の追加利上げ時期に関する思惑によりリートは一進一退の動きとなりましたが、2016年6月からは市場予想を上回る経済指標の発表や米国リーートの好調な決算が続いて再び上昇しました。8月以降は、F R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などから米国の早期利上げ観測が強まったため長期金利が上昇したことなどが嫌気され、米国リートは軟調に推移しました。11月下旬から期末にかけては、トランプ次期米国大統領への政策期待などからやや持ち直しました。

欧州では、設定時より、英国のE U離脱問題が嫌気され上値が重い展開となりましたが、英国のE U離脱派の勝利後は金融を中心に欧州大陸でのオフィス需要が高まるという見方で一時反発しました。期末にかけては、E C B（欧州中央銀行）の金融緩和策縮小観測もあり、欧州リートは売られました。英国リートは、E U離脱派の勝利によるオフィス需要の減少が懸念されたことから、6月以降は欧州大陸と比べてさえない動きとなりました。

アジアでは、設定時より、香港は中国政府の追加経済対策や深セン・香港コネクト（深センと香港証券取引所の相互取引制度）の開始が決定されることによる資金流入が期待されたことから、2016年7月まで上昇を続けました。その後はボックス圏で推移し、期末にかけては中国本土の不動産規制の強化などを受けて軟調となりました。シンガポールでは、設定時より、長期金利の低下と相対的に高い配当利回りを受けて緩やかに上昇しましたが、10月以降は長期金利上昇を嫌気して下落基調に転じました。

オーストラリアでは、設定時より、R B A（オーストラリア準備銀行）に対する利下げ期待が根強いことや、相対的に堅調な国内景気に支えられる形で堅調に推移しました。8月以降は、オーストラリアでも長期金利が上昇したことから下落に転じましたが、期末にかけてはやや持ち直しました。

○国内債券市況

国内長期金利は、設定時より、日銀の追加金融緩和への期待などから低下基調で推移しました。2016年7月末には、日銀はE T F（上場投資信託）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、欧米の長期金利が上昇する中、国内長期金利は一段と上昇しました。

○海外債券市況

海外債券市況は、設定時より、米国の早期利上げ観測が後退したことや、英国のE U離脱を問う国民投票でE U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。2016年7月に各国金利は反発し上昇しましたが、8月にはB O E（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、E C Bの資産買い入れの減額観測が出たことやB O E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や12月の米国の利上げも、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、米ドルは、設定時より、原油価格の低下などを受けたリスク回避の動きを受けて米ドル安となりました。米国の早期追加利上げ観測の後退や期待に反して日銀が金融政策の現状維持を決定したこと、英国のE U離脱派の勝利も円高材料となりました。2016年8月以降は、日銀の金融政策の手詰まり感はあったものの、米国の早期利上げ観測が強まったことから緩やかな米ドル高となり、11月初旬の米国大統領選挙以降は、日米長期金利差の拡大などにより米ドル高基調が強まりました。

ユーロおよび英ポンドは、設定時より、欧州の信用不安が再燃したことや英国でE U離脱議論が高まったことが嫌気され、ユーロ安、英ポンド安となりました。実際に国民投票で英国のE U離脱派が勝利すると、ユーロは結果として下げ止まりましたが、英ポンドは英国経済への影響が懸念されたことから英国のE U離脱派の勝利による急落後も、英ポンド安が進みました。11月初旬以降は、長期金利の上昇を受けてユーロ高、英ポンド高が進行しました。

オーストラリア・ドルは、設定時より、中国の景気悪化懸念やR B Aの利下げなどで2016年6月まではオーストラリア・ドル安基調でしたが、7月以降は資源価格が上昇に転じたことや長期金利の上昇などもあり、オーストラリア・ドル高に転じて持ち直しました。

ポートフォリオについて

○当ファンド

当ファンドの特色に基づき、6種類（国内株式・海外株式・国内リート・海外リート・国内債券・海外債券）の各マザーファンドの受益証券へ基本配分比率を参考に投資を行ないました。

当期における基本配分比率は、純資産総額に対してそれぞれ以下の通りとしました。

	設定～期末
トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券	48%
外国株式インデックスマザーファンドの受益証券	32%
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券	5%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券	5%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券	5%
外国債券インデックスマザーファンドの受益証券	5%

○トピックス・インデックス・マザーファンド

株式を中心に、一部ＴＯＰＩＸ先物取引も利用し、株式組入比率（株式先物を含む。）につきましては、期を通じておおむね100％程度を維持しました。株式ポートフォリオは、最適化の手法（株価変動を数理的にいくつかの要因に分解し、それに基づいて、ポートフォリオがＴＯＰＩＸと同じように変動するよう、銘柄、株数を決定するシステムの手法）を用いて構築しています。

期中、資金変動への対応、新規上場等の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。

○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＆Ｐ500先物取引も一部利用し、株式組入比率（リート、株式先物を含む。）につきましては、期を通じておおむね100％程度の水準を維持しました。外国株式等のポートフォリオ構築にはリスクモデルを利用し、ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、基準価額とベンチマーク（ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース））との連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

○ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

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

○ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエートで組成し、ベンチマーク（Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース））との連動性を維持するような運用を行ないました。リートポートフォリオにつきましては、浮動株修正後の時価総額が小さく投資単位等の関係で組み入れなかった銘柄と当社において組み入れを行なわないと判断した銘柄を除き、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）採用銘柄全銘柄に投資しました。

○ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

当ファンドの騰落率が、ベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）の騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行ないました。期を通じて、公社債組入比率を99％前後の高位に保つ

と同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入出や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行ないました。

○外国債券インデックスマザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

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

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目		当 期
		2016年5月13日 ～2016年12月19日
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	1,331

- （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

マザーファンドの受益証券への投資を通じて、2050年に近づくにしたがって株式等の組み入れを漸減させ、債券の組み入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく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。

○外国株式インデックスマザーファンド

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

○ダイワJーREITマザーファンド

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

○ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークであるS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。リートの組入比率は、期を通じて原則として97%以上で運用を行ないます。また、保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

○ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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

○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
	(2016.5.13～2016.12.19)		
	金 額	比 率	
信託報酬	24円	0.235%	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10,018円です。
(投信会社)	(11)	(0.108)	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)	(11)	(0.108)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後 の情報提供等の対価
(受託銀行)	(2)	(0.020)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0.001	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
有価証券取引税	0	0.002	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)	(0.001)	
その他費用	5	0.048	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.024)	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)	(2)	(0.022)	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)	(0.002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	29	0.286	

(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

(2016年5月13日から2016年12月19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	607	489	14	11
外国株式インデックスマザーファンド	189	339	7	13
外国債券インデックスマザーファンド	19	52	1	4
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	19	50	0	2
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	24	51	1	2
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	40	52	5	7

(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

(2016年5月13日から2016年12月19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	11,879,816千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	115,678,172千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.10
	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	5,172,035千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	69,608,396千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.07

(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

(2016年5月13日から2016年12月19日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
株式	百万円 4,775	百万円 1,636	% 34.3	百万円 7,104	百万円 —	% —
株式先物取引	8,180	—	—	9,876	—	—
コール・ローン	542,018	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.0%

※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) 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。

(4) 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。

(5) ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(6) ダイワ・グローバルＲＥＩＴ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。

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

(2016年5月13日から2016年12月19日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
公社債	百万円 2,691	百万円 293	% 10.9	百万円 2,143	百万円 205	% 9.6
コール・ローン	12,940	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.0%

(8) 利害関係人の発行する有価証券等

(2016年5月13日から2016年12月19日まで)

種 類	当 期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株式	百万円 9	百万円 6	百万円 405
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド		
投資信託証券	百万円 1,280	百万円 5	百万円 6,166

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(9) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2016年5月13日から2016年12月19日まで)

種 類	当 期	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	
	買 付 額	期 末 保 有 額
投資信託証券		百万円 694

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(10) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

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

(注1) 金額は元本ベース。
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
トピックス・インデックス・マザーファンド	千口 593	千円 559
外国株式インデックスマザーファンド	182	380
外国債券インデックスマザーファンド	17	48
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	18	45
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ インデックス・マザーファンド	23	50
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	34	44

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年12月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
トピックス・インデックス・マザーファンド	千円 559	% 49.4
外国株式インデックスマザーファンド	380	33.6
外国債券インデックスマザーファンド	48	4.3
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	45	4.0
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ インデックス・マザーファンド	50	4.5
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	44	3.9
コール・ローン等、その他	3	0.3
投資信託財産総額	1,133	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、12月19日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝117.63円、1カナダ・ドル＝88.19円、1オーストラリア・ドル＝85.85円、1香港ドル＝15.15円、1シンガポール・ドル＝81.47円、1ニュージーランド・ドル＝82.07円、1イギリス・ポンド＝146.91円、1イスラエル・シェケル＝30.36円、1スイス・フラン＝114.60円、1デンマーク・クローネ＝16.55円、1ノルウェー・クローネ＝13.58円、1スウェーデン・クローネ＝12.58円、1メキシコ・ペソ＝5.76円、1マレーシア・リンギット＝26.27円、1南アフリカ・ランド＝8.36円、1ポーランド・ズロチ＝27.78円、1ユーロ＝123.01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（84,517,700千円）の投資信託財産総額（84,671,359千円）に対する比率は、99.8%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（159,051,260千円）の投資信託財産総額（159,470,725千円）に対する比率は、99.7%です。
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（6,098,489千円）の投資信託財産総額（6,498,597千円）に対する比率は、93.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年12月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,133,600円
コール・ローン等	3,978
トピックス・インデックス・マザーファンド(評価額)	559,446
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	380,769
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	48,637
ダイワJ-REITマザーファンド(評価額)	45,904
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド(評価額)	50,788
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)(評価額)	44,078
(B) 負債	424
未払信託報酬	387
その他未払費用	37
(C) 純資産総額(A - B)	1,133,176
元本	1,000,000
次期繰越損益金	133,176
(D) 受益権総口数	1,000,000口
1万口当たり基準価額(C / D)	11,332円

* 期首における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は0円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,332円です。

■損益の状況

当期 自2016年5月13日 至2016年12月19日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	135,622円
売買益	140,375
売買損	△ 4,753
(B) 信託報酬等	△ 2,446
(C) 当期損益金(A + B)	133,176
(D) 合計(C)	133,176
次期繰越損益金(D)	133,176
分配準備積立金	133,176

(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) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	133,176
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	133,176
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	133,176
(h) 受益権総口数	1,000,000口

＜補足情報＞

当ファンド（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050）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12月19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

(2016年5月13日から2016年12月19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
日本電信電話		30.1	141,719	4,708	ソフトバンクグループ		72.6	485,569	6,688	九州旅客鉄道		43.1	129,912	3,014	トヨタ自動車		31.78	201,940	6,354	
東日本旅客鉄道		10.3	97,149	9,431	三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ		343.5	200,552	583	日本電産		8	77,367	9,670	日産自動車		119.2	124,858	1,047	
デンソー		17.5	77,161	4,409	日本たばこ産業		30.1	120,295	3,996	ペプシドリーム		10.5	73,162	6,967	アステラス製薬		61.6	98,900	1,605	
トヨタ自動車		11.7	61,720	5,275	KDDI		30.8	94,574	3,070	リクルートホールディングス		13	54,080	4,160	みずほフィナンシャルＧ		494.5	92,209	186	
野村ホールディングス		96	50,753	528	東京エレクトロン		9.6	87,570	9,121	本田技研		15.8	45,496	2,879	東海旅客鉄道		4.8	86,326	17,984	

(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12月19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（138,207,285千口）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	柄	2016年12月19日現在 株数 評価額	銘柄	柄	2016年12月19日現在 株数 評価額	銘柄	柄	2016年12月19日現在 株数 評価額	銘柄	柄	2016年12月19日現在 株数 評価額
水産・農林業 (0.1%)	千株	千円	水産・農林業 (0.1%)	千株	千円	水産・農林業 (0.1%)	千株	千円	水産・農林業 (0.1%)	千株	千円
極洋	3.2	8,688	鹿島建設	284	233,448	住友林業	43.8	69,510	千代田化工建	45	38,565
日本水産	84.1	46,086	不動テトラ	57.6	12,096	日本基礎技術	13.7	4,973	新興プランテック	14.4	12,369
マルハニチロ	12.2	37,271	鉄建建設	42	14,658	日成ビルド工業	21	10,899	食料品 (4.4%)		
カネコ種苗	3.9	6,025	西松建設	75	43,050	パナホーム	24	20,520	日本製粉	18.5	29,933
サカタのタネ	9.6	31,248	三井住友建設	247.7	31,457	大和ハウス	190.1	625,809	日清製粉G本社	70.2	121,726
ホクト	6.6	14,084	大豊建設	24	13,824	ライト工業	12.6	15,573	昭和産業	26	15,704
鉱業 (0.4%)			前田建設	40	42,280	積水ハウス	201.9	388,556	中部銅料	8.1	8,124
日鉄鉱業	2	11,360	奥村組	51	33,915	ユアテック	11	8,998	フィード・ワン	48.2	7,230
三井鉱山	6	8,136	東鉄工業	7.8	22,877	西部電気工業	3.2	6,995	日本甜菜糖	4.1	9,794
国際石油開発帝石	339.7	418,340	浅沼組	24	9,264	中電工	7.7	19,658	三井製糖	4.5	11,259
日本海洋堀削	2.6	6,676	戸田建設	76	48,336	関電工	26	27,534	塩水港精糖	22.7	5,606
石油資源開発	9.8	26,763	熊谷組	102	31,008	きんでん	42.6	63,474	日新製糖	3.3	5,425
K&Qエナジーグループ	4.6	8,712	北野建設	27	8,613	東京エネシス	7	7,245	森永製菓	12.7	60,515
建設業 (3.0%)			三井ホーム	12	5,856	トーエネック	10	5,800	中村屋	2.1	10,069
ショールズHD	4.7	33,500	矢作建設	9.7	10,223	住友電設	4.8	6,148	江崎グリコ	16.2	85,860
ミライト・ホールディングス	19.7	20,960	ピーエス三菱	16.1	5,989	日本電設工業	10.4	19,988	不二家	39	8,853
タマホーム	10.1	5,474	日本ハウスHLDGS	18.2	9,063	協和エクシオ	24.9	42,379	山崎製パン	47.3	108,458
安藤・間	46.6	35,835	大東建設	23.7	412,617	九電工	12.7	38,481	モロゾフ	19	9,177
東急建設	23.1	21,436	新日本建設	8.1	7,638	三機工業	14.4	13,896	亀田製菓	3.7	19,240
コムシスホールディングス	24.9	52,763	NIPPO	14	30,660	日揮	59.7	131,101	寿スピリッツ	4.9	13,455
ミサワホーム	8.7	8,961	東亜道路	23	7,866	中外炉工業	30	6,600	カルビー	26.3	97,573
高松コンストラクションGP	4.9	12,142	前田道路	19	36,708	太平電業	9	10,215	森永乳業	58	45,936
東建コーポレーション	2.7	23,166	日本道路	20	9,460	高砂熱学	17.7	27,346	六甲バター	3.2	7,945
大成建設	328	275,520	東亜建設	5.3	10,361	明星工業	13.5	7,695	ヤクルト	34.5	186,300
大林組	193.6	218,187	若築建設	57	8,892	大気社	8.4	23,940	明治ホールディングス	38.2	345,328
清水建設	198	216,612	東洋建設	20.8	8,590	ダイダ	10	9,710	雪印メグミルク	14	43,820
飛島建設	68.5	13,289	五洋建設	71.3	40,926	日比谷総合設備	7.5	12,382	プリマハム	41	16,441
長谷工コーポレーション	74.9	89,355	大林道路	8.1	5,904	東芝プラントシステム	10.2	17,166	日本ハム	44	137,280
松井建設	8.2	8,782	世紀東急	14.3	7,207	OSJBHD	24.2	5,953	丸大食品	31	14,911
			福田組	11	13,046	東洋エンジニア	37	11,359	S Foods	3.7	10,689

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
伊藤ハム米久HLDGS	千株	千円	化学 (6.5%)	千株	千円	中国塗料	千株	千円	キッセイ薬品工業	千株	千円
サッポロホールディングス	37.5	38,475	クラレ	99.9	176,423	日本特殊塗料	17.6	15,329	生化学工業	10.3	29,221
アサヒグループホールディングス	20.7	62,307	旭化成	375	392,625	藤倉化成	5	8,445	栄研化学	11.1	18,703
キリンHD	120.6	423,909	共和レザー	6.2	5,195	太陽ホールディングス	11.1	7,326	日本製薬	5.1	15,045
宝ホールディングス	277.4	535,936	昭和電工	4.8	22,272	D I C	23.6	86,966	鳥居薬品	4.5	5,755
オエノンホールディングス	45.8	47,540	住友化学	39.8	69,888	サカタックス	12	17,592	J C R ファーマ	4.3	10,965
コカ・コーラウエスト	29	7,888	日本化成	441	258,867	東洋インキSホールディングス	12	17,592	東和薬品	4.9	13,024
コカ・コーライストジャパン	21.9	74,788	住友精化	48	7,968	T & K T O K A	54	29,160	富士製薬工業	2.9	13,093
サントリー食品インター	25.1	63,754	日産化学	2.6	11,596	富士フイルムHLDGS	6.3	6,344	第一三共	2.3	6,108
ダイドードリンコ	44.3	217,070	ラサ工業	32.8	130,216	資生堂	119	532,763	沢井製薬	10.1	62,014
伊藤園	2.8	16,156	クレハ	61	8,479	ライオン	114.3	341,871	ゼリア新薬工業	12.2	22,423
キーコーヒー	19	70,490	テイカ	4.4	20,196	高砂香料	75	140,175	第一三共	176.8	426,176
日清オイリオグループ	6.3	13,601	石原産業	11.5	11,304	マンダム	4	12,340	大幸薬品	14	34,748
不二製油グループ	36	18,828	日東エフシー	5.9	5,339	ミルボン	6.1	30,408	ダイト	4.1	7,441
J-オイルミルズ	17.1	38,475	日本曹達	3.4	15,045	ファンケル	3.4	15,045	大塚ホールディングス	3.9	8,576
キューマン	3	11,280	東ソー	36	19,440	コーセー	12.9	21,065	大正製薬HD	129.4	648,035
味の素	45	168,075	トクヤマ	174	148,770	シーズ・ホールディングス	9.8	97,216	ペプチドリーム	12.8	124,800
キューピー	322.704	322,704	セントラル硝子	94	43,710	ポーラ・オルビスHD	7.9	26,425	石油・石炭製品 (0.5%)	10.3	58,298
ハウス食品G本社	32.9	89,817	東亜合成	61	32,757	エヒオホールディングス	6.2	59,024	日本コークス工業	65.9	7,249
カゴメ	23.4	55,785	大阪ソーダ	35.5	40,470	コニシ	14,137	9,125	昭和シェル石油	53.4	61,249
アリアケジャパン	2.1	66,412	関東電化	27	12,960	長谷川香料	9.9	12,543	ニチレキ	9.3	8,500
ニチレイ	5.4	33,156	デンカ	13	13,481	星光PMC	7.6	15,184	東燃ゼネラル石油	9.7	122,705
東洋水産	31.9	75,634	信越化学	122	64,660	小丸製薬	4.2	5,031	ユシロ化学	48	6,960
日清食品HD	31.4	130,467	日本カーバイド	107.9	989,335	荒川化学工業	16.8	85,512	富士石油	9.8	6,988
永谷園ホールディングス	25.1	151,855	堺化学	51	8,109	メック	5.5	9,823	MORESCO	16.6	6,988
フジッコ	7	9,373	エプ・ウォーター	22	8,558	日本高純度化学	5.6	5,168	出光興産	3.8	6,102
ロッフィード	6.5	15,249	太陽日酸	49.2	104,008	タカラバイオ	3.8	9,325	J Mホールディングス	28.5	90,202
日本たばこ産業	7.6	11,658	日本化学工業	46.5	64,681	JCU	12.9	18,834	コスモエネルギーHDGS	661.2	332,848
ケンコムマヨネーズ	356.5	1,399,619	日本バーカラライジング	26	6,344	新田ゼラチン	2.1	11,193	ゴム製品 (0.9%)	18.2	30,976
わらべや日洋HD	2.6	8,385	高圧ガス	30.2	42,884	デクセリアルズ	8.5	6,120	横浜ゴム	36.1	79,059
ユーグレナ	4.1	10,090	四国化成	10.4	7,893	アース製薬	15.8	16,526	東洋ゴム	31.9	50,816
ミヨシ油脂	20.9	26,814	戸田工業	9	9,495	イハラセミカル	4.5	21,825	ブリヂストン	202.9	895,803
理研ビタミン	56	8,344	ステラ ケミファ	16	4,624	北興化学	9.2	10,727	住友ゴム	55.7	108,225
繊維製品 (0.7%)	2	9,370	保土谷化学	3	8,904	大成ラミック	14	6,440	藤倉ゴム	10.4	7,196
片倉工業	8.1	11,477	日本触媒	2.4	6,504	クミアイ化学	3.4	10,489	オカモト	19	19,893
グンゼ	9.3	68,541	大日精化	9.3	68,541	日本農業	13.4	9,782	ニッパ	5.4	17,280
東洋紡	44	16,588	カネカ	24	15,336	アキレス	14.1	9,320	住友理工	10.6	12,158
ユニチカ	235	41,360	三菱瓦斯化学	80	79,040	有沢製作所	5.7	9,348	三ツ星ベルト	15	15,030
富士紡ホールディングス	171	14,364	三井化学	55.7	111,344	日東電工	12.8	8,422	バンドー化学	10.9	11,445
倉敷紡績	3.1	10,044	J S R	272	149,056	レック	43.4	396,111	ガラス・土製品 (1.0%)		
シキボウ	60	13,860	東京応化工業	59.8	108,596	きもと	2.5	8,900	日東紡績	49	23,177
日本毛織	64	8,832	大阪有機化学	11.3	42,827	藤森工業	20.3	5,135	旭硝子	296	249,232
ダイドールミテッド	16.3	13,985	三菱ケミカルHLDGS	401	317,231	前澤化成工業	4.6	13,781	日本板硝子	27.4	24,660
帝国繊維	18.8	7,595	ダイセル	6.1	6,148	ジェイ エス ピー	8.5	9,962	日本山村硝子	34	7,004
帝人	6.6	10,982	住友ベークライト	81.2	108,402	エフピコ	2.8	7,803	日本電気硝子	123	81,549
東レ	48.6	115,133	積水化学	52	34,528	天馬	5.4	28,890	住友大阪セメント	111	46,953
サカイ オーベックス	436	417,339	日本ゼオン	136	246,840	信越ポリマー	4.1	8,277	太平洋セメント	362	133,216
住江織物	2.8	5,003	アイカ工業	50	56,500	東リ	13.1	11,357	日本ヒューム	8.7	6,264
アツギ	22	5,522	宇部興産	19	58,615	ニフコ	22.2	8,347	日本コンクリート	17.5	6,230
セーレン	74	9,324	積水樹脂	29.7	73,656	日本バルカー	10.4	64,480	アジアパイルHD	10.8	5,875
ソート	15.4	22,884	タキロン	9.4	17,559	ユニ・チャーム	5.8	8,908	東海カーボン	56	21,896
東海染工	6.1	6,990	旭有機材	15	7,770	医薬品 (4.6%)	122.2	312,709	日本カーボン	36	8,856
小松精練	53	7,367	日立化成	33.2	96,479	協和発酵キリン	72	117,144	東洋炭素	3.8	7,273
ワコホールディングス	11.9	8,806	ニチン	37	5,761	武田薬品	225.3	1,085,946	ノリタケ	3.6	9,871
ホギメディカル	34	46,988	リケンテクノス	3.7	5,761	アステラス製薬	614.4	1,001,779	TOTO	44.1	204,624
T S Iホールディングス	3.8	26,600	大倉工業	13.9	7,589	大日本住友製薬	42.5	82,747	日本碍子	76.1	179,672
三陽商会	24.4	17,372	積水化成	18	8,874	塩野義製薬	81.5	427,304	日本特殊陶業	52	143,624
オンワードホールディングス	40	7,040	群衆化学	9	7,434	田辺三菱製薬	70.2	159,283	MA RUWA	2.4	9,540
ゴールドウイン	28	31,312	タイガース ポリマー	1.8	5,832	あすか製薬	7.1	11,715	品川フラスクリーズ	2.5	6,225
デサント	3.7	14,499	ダイキョーニシカワ	6.1	4,995	日本新薬	70.2	11,715	黒崎播磨	18	5,706
パルプ・紙 (0.2%)	14.1	19,274	日本化学	10.8	16,351	中外製薬	13.9	78,674	フジモンコーポレート	5.4	11,820
特種東海製紙	39	55,887	カーリットホールディングス	39	55,887	科研製薬	60.1	199,231	ニチアス	32	35,488
王子ホールディングス	3.7	14,652	日本精化	13.3	7,448	エーザイ	11.2	69,888	ニチハ	8.2	23,353
日本製紙	229	114,729	扶桑化学工業	8.4	7,534	ロート製薬	74.1	501,212	鉄鋼 (1.3%)		
三菱製紙	26	53,846	ADEKA	4.4	10,643	小野薬品	29.3	52,710	新日鐵住金	271.1	732,783
北越紙州製紙	24.8	41,316	日油	24.8	41,316	久光製薬	137	342,020	神戸製鋼所	103.5	125,752
中越パルプ	32.7	22,301	花王	47	51,230	持田製薬	16.8	94,584	中山製鋼所	7.8	5,935
巴川製紙	28	6,804	第一工業製薬	153.1	859,809	参天製薬	4	32,120	合同製鐵	3.7	8,073
大正製紙	19	4,351	三洋化成	19	7,030	扶桑薬品	110.1	154,140	J F Eホールディングス	164	307,008
レインボー	23.7	30,525	大日本塗料	3.5	17,675	ツムラ	2.7	7,503	日新製鋼	26.9	39,785
トーモク	56.5	37,233	日本ペイントHOLD	37	8,325	日医工	19.9	63,680	東京製鐵	30.4	26,782
ザ・パックス	24	7,920	関西ペイント	46.4	148,016		14	23,982	共英製鋼	6.5	13,799

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額
大和工業	11.9	千円 39,270	滝澤鉄工所	54	千円 8,910	グローリー	18.2	千円 67,795	京三製作所	19	千円 7,410
東京鐵鋼	16	7,744	富士機械製造	18	24,624	新晃工業	4.8	6,619	能美防炎	6.7	11,611
大阪鐵鋼	4.1	8,470	富野フライス	30	28,860	大和冷機工業	9.7	8,846	ホーチキ	5.1	6,936
淀川製鋼所	8.1	25,474	オースジー	26.8	63,167	セガサミーホールディングス	56.7	101,209	エレコム	5.4	10,524
東洋鋼板	15.7	6,154	旭ダイヤモンド	17.8	15,628	日本ビストンリング	4.3	8,995	日本無線	4	5,416
丸一鋼管	19.9	73,928	DMG森精機	35.7	54,978	リケン	2.9	13,035	パナソニック	656.3	840,720
大同特殊鋼	99	49,698	ソディック	16	15,712	T P R	6.5	22,425	アンリツ	40.7	25,925
日本高周波	89	7,832	ディスコ	7	93,940	ツバキ・ナカシマ	6.6	11,503	富士通ゼネラル	20	45,960
日本冶金工	57.6	11,692	日東工器	3.9	9,722	ホシザキ	12.6	111,510	日立国際電気	15.1	35,636
山陽特殊製鋼	35	19,810	O K K	6.5	7,735	大豊工業	5	8,465	ソーニー	405.2	1,369,981
愛知製鋼	3.4	17,680	島精機製作所	7.9	30,336	日本精工	118	166,380	T D K	32.3	269,705
日立金属	61	97,539	フレュー	1.4	4,634	N T U	132	67,452	帝国通信工業	32	5,696
大太平洋金属	39	15,444	日阪製作所	10	8,940	ジェイテクト	60.7	117,879	ミツミ電機	20.6	14,481
新日本電工	40.6	10,312	やまびこ	11.7	16,625	不二越	56	29,064	タムラ製作所	24	10,824
栗本鉄工所	3.3	7,943	ペガサスミシン製造	8.4	5,964	日本トムソン	20.2	10,362	アルプス電気	53.1	154,945
日本精鉄管	25	4,900	ナプテスコ	30.9	86,149	T H K	40.2	105,324	パイオニア	86.8	21,873
三菱製鋼	45	10,575	三井海洋開発	6	11,562	ユージン精機	2.9	7,844	日本電波工業	7.7	6,937
シンニッタン	10.3	6,911	レオン自動機	6.6	5,860	イーグル工業	6.4	10,246	日本トリム	1.5	6,570
非鉄金属 (0.9%)			SMC	18	510,750	日本ピラー工業	7.2	8,820	ローランド ディー・ジー	3.4	10,625
大紀アルミニウム	14	7,392	新川	7.1	5,459	キッツ	27.4	18,467	フオスター電機	6.9	15,490
日本軽金属HD	130.2	32,810	ホソカワミクロン	13	10,062	日立工機	14.9	18,312	クラリオン	31	13,020
三井金属	163	51,182	ユニオンツール	2.7	8,051	マキタ	37.4	289,476	S M K	17	7,548
東邦亜鉛	35	16,625	オイスエ工業	7.7	16,146	日立造船	43.1	26,808	ヨコオ	6.9	6,403
三菱マテリアル	37.3	138,383	サトーホールディングス	7.7	19,057	三菱重工業	962	529,869	ホシデン	18	17,532
住友鉱山	156	239,772	日精樹脂工業	6.2	6,293	スター精密	441	142,884	ヒロセ電機	9.2	132,388
DOWAホールディングス	67	61,372	日松製作所	277.4	734,971	電気機器 (12.5%)	9.9	15,909	日本航空電子	18	31,788
古河機金	97	21,631	住友重機械	175	132,300	日清紡ホールディングス	30.7	35,704	T O A	7.9	8,271
大阪チタニウム	7.1	11,828	日立建機	26.6	66,845	イビデン	39.5	66,557	日立マクセル	8.5	17,671
東邦チタニウム	11	8,998	巴工業	4.9	7,727	ユニカミノルタ	133.3	154,761	エディンホールディングス	40	6,960
U A C J	76	23,712	井関農機	6.2	14,446	ブラザー工業	74.1	157,758	アルパイン	13.7	21,344
古河電工	20	66,900	T O W A	5.7	7,797	ミネベア	92.6	110,934	スミダコーポレーション	5.3	5,209
住友電工	226.2	382,051	丸山製作所	43	8,213	日立	1,376	896,051	アイコム	4	8,512
フジクラ	76.9	48,908	北川鉄工所	3.6	8,452	東芝	1,285	595,083	リオン	3.4	5,528
昭和電線 H L D G S	101	9,292	ロウエツ	2.4	4,029	三菱電機	612	1,013,472	船井電機	7	6,916
タツタ電線	13.4	6,257	三菱化工機	288.6	497,979	富士電機	172	104,232	横河電機	61.3	103,597
リョービ	37	18,093	月島機械	11.9	14,970	東洋電機製造	3.6	5,853	新電元工業	22	10,032
アールステイ	7.7	9,609	帝国電機製作所	6.8	6,609	安川電機	66	121,242	アズビル	17	55,505
アサヒHD	8.9	18,467	新東工業	14.4	15,105	シンフォニア テクノロジ	41	11,234	日本光電工業	23.8	61,308
金属製品 (0.7%)			渋谷工業	5.2	12,542	明電舎	53	21,147	共和電機	15.5	6,277
稲葉製作所	4.8	6,360	アイチ コーポレーション	9.7	8,390	山洋電機	16	13,456	堀場製作所	11.2	60,816
宮地エンジニアリングG	30	5,730	小森コーポレーション	14.3	22,036	デンヨー	5.7	9,171	アドバンテスト	38.9	63,796
トーカロ	4.4	11,572	鶴見製作所	5.2	9,074	東芝テック	36	20,592	エスベック	5.9	7,693
S U M C O	63.1	98,436	住友精密	18	6,588	芝浦メカトロニクス	18	4,788	キーエンス	13	1,031,290
川田テクノロジーズ	1.3	8,970	荏原製作所	24.6	78,843	マフチモーター	16.2	102,546	日置電機	3.5	7,553
東洋製鐵グループHD	41.7	92,657	西島製作所	7.4	8,265	日本電産	74.5	746,862	シスメックス	44.7	290,550
ホッカンホールディングス	21	9,114	北越工業	10	7,980	日本電産 東光高岳	3.3	6,778	日本マイコンロニクス	11.3	12,486
横河ブリッジH L D G S	11	14,872	ダイキン工業	78.3	837,810	ダブル・スコープ	5.7	9,108	メガチップス	5.7	14,244
駒井ハルテック	2.8	6,143	オルガノ	16	7,456	ダイヘン	31	22,816	O B A R A G R O U P	3.5	18,830
三和ホールディングス	59.6	66,632	トヨーカネツ	32	10,080	田淵電機	12.2	5,075	コーセル	8.7	11,423
文化シヤッター	17.4	16,112	栗田工業	33.2	82,004	J V C ケンウッド	43.8	14,059	イリソ電子工業	1.8	11,952
三協立山	7.9	13,279	椿本チエイン	33	32,340	日新電機	11.7	14,379	オプテックス	4.5	11,515
ラインコ	6.5	6,747	アネスト岩田	11.4	13,018	大崎電機	12	14,436	千代田インテグレ	3.4	8,435
L I X I L グループ	83.8	225,086	ダイフク	29	67,889	オムロン	61	280,600	レーザータック	7	14,336
ノーリツ	11.5	23,690	加藤製作所	3.6	10,702	日東工業	8	13,256	スタンレー電気	40.9	131,902
長府製作所	10.5	17,771	油研工業	38	8,208	I D E C	8.2	9,159	岩崎電気	37	6,808
リンナイ	6.2	95,880	タノ	30.2	47,504	ジーエス・ユアサ コーポ	109	53,737	ウシオ電機	34.8	51,712
岡部	13.3	13,353	フジテック	17	22,712	サクサホールディングス	20	4,400	日本セラミック	5.1	10,689
ジーテクト	6.3	14,874	C K D	17.1	24,692	メルコホールディングス	3.4	10,863	遠藤照明	6.4	5,542
東プレ	11.6	34,359	キトー	8.5	10,599	富士通	787	252,627	日本デジタル研究所	6.1	14,621
高周波熱練	12	10,800	平和	17.5	46,200	沖電気	554	381,650	古河電池	6	4,518
東京製鋼	4.6	9,397	理想科学工業	5.8	11,507	電気興業	24.6	41,352	山一電機	6.5	7,286
パイオラックス	3.1	23,343	S A N K Y O	15.5	58,900	サンケン電気	38	10,422	図研	5.3	6,434
日本発条	54.9	59,566	日本金銭機械	5.8	8,265	アイホン	14	19,210	日本電子	2.2	11,616
三益半導体	5.1	8,262	マースエンジニアリング	3.5	7,766	ルネサスエレクトロニクス	4.1	7,900	カシオ	48.2	82,229
機械 (4.9%)			福島工業	3.8	12,236	セイコーエプソン	31.8	31,959	ファナック	58.2	1,183,788
日本製鋼所	19.9	41,630	ダイコク電機	3.3	5,903	ワコム	85.3	208,558	日本シイエムケイ	13.6	9,696
三浦工業	24.6	43,886	竹内製作所	10.7	28,569	アルバック	46.2	14,322	エンプラス	2.7	9,774
タクマ	19.4	17,770	アルノ	17.6	36,062	アクセル	10.6	37,206	ローム	27.7	187,252
ツガミ	17	11,934	J U K I	9.9	11,028	E I Z O	5.1	5,125	浜松ホトニクス	44.7	139,687
オークマ	39	44,733	サンデンホールディングス	37	14,319	ジャパントニクス	5.7	20,092	三井ハイテック	8.8	7,409
東芝機械	36	17,100	蛇の目マシン	7.3	6,197	日本信号	107.3	36,803	新光電気工業	20	15,960
アマダホールディングス	79.7	105,044	マックス	9	13,050		15.8	15,152	京セラ	94.1	551,426
アイダエンジニア	17.3	18,857									

銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額
2016年12月19日現在	2016年12月19日現在	2016年12月19日現在	2016年12月19日現在	2016年12月19日現在	2016年12月19日現在	2016年12月19日現在	2016年12月19日現在	2016年12月19日現在	2016年12月19日現在	2016年12月19日現在	2016年12月19日現在
太陽誘電	千株	千円	島津製作所	千株	千円	電源開発	千株	千円	東海運	千株	千円
村田製作所	27.2	38,352	JMS	74	133,274	イーレックス	45.5	131,313	情報・通信業 (7.6%)	8.7	3,749
ユニシオン	60.3	963,895	ブイ・テクノロジー	24	7,272	東京瓦斯	2.5	7,110	NECネットエスアイ	4.9	5,777
双葉電子工業	10	7,340	東京計器	1.2	14,136	大阪瓦斯	615	333,760	システナ	6	12,816
北陸電気工業	9.5	18,582	東京精密	32	7,296	東邦瓦斯	554	255,449	デジタルアーツ	5.1	8,267
ニチコン	45	6,075	マニ	10.9	35,915	北海道瓦斯	144	138,672	新日鉄住金 SOL	2.9	7,403
日本ゲミコン	18	18,504	ニコン	21	21,583	広島ガス	21	5,796	ソフトクリエイトHD	9.5	19,646
KOA	52	13,832	トプコン	15.5	5,859	静岡瓦斯	65	16,575	T I S	5.8	7,719
市光工業	8.8	10,005	オリンパス	17.4	14,807	メタウォーター	3.4	9,768	電算システム	18.9	46,834
小糸製作所	15	5,685	理研計器	91.6	9,450	陸運業 (4.3%)			グリー	3.1	5,877
ミツバ	34.6	213,136	タムロン	5.2	10,545	SBSホールディングス	6.4	5,504	コーエーテックモHD	35.7	22,169
SCREENホールディングス	10.8	19,461	HOYA	118.1	572,076	東武鉄道	304	175,104	三菱総合研究所	13.6	26,628
キャノン電子	11.8	81,066	ノーリツ鋼機	6.9	5,630	相鉄ホールディングス	92	53,268	ファイナデックス	2.5	8,025
キャノン	308.1	1,052,777	エー・アンド・ディ	12.7	6,045	東京急行	312	275,184	K L a b	4.8	4,358
リコー	171.6	174,002	リズム時計	63.3	47,031	京浜急行	157	207,868	ボルタウイン・ビートル	12.2	7,930
東京エレクトロン	38.3	409,810	大研医器	39	7,059	小田急電鉄	157	214,408	ネクソン	5.6	5,594
輸送用機器 (10.0%)			メニコン	6.9	5,582	京王電鉄	92.1	204,408	アイスタイル	62.5	102,687
トヨタ紡織	20.2	54,863	松風	4.1	12,669	京王電鉄	160	153,760	エイチーム	9.4	7,369
ユニプレス	11.1	25,951	セイコーHD	4.1	5,518	富士急行	43	122,636	テクノスジャパン	3.7	8,029
豊田自動織機	52.3	300,725	ニプロ	40	18,000	新東京電鉄	17	18,224	コロプラ	4.8	5,385
モリタホールディングス	10.9	17,668	その他製品 (1.8%)	38.4	48,499	東日本旅客鉄道	13	5,356	ブロードリーフ	16.1	16,164
三機工業	10.2	8,068	パラマウントベッドHD	5.5	24,942	近鉄グループホールディングス	111.1	1,137,108	ハーツコイデッドグループ	15.2	10,077
デンソー	141.6	732,780	ニホンフラスシュ	3.8	4,997	東海旅客鉄道	55.2	397,108	ティーガイア	3.5	5,505
東海理化電機	15	36,330	前田工業	7	8,687	西武ホールディングス	47.7	928,242	豆蔵ホールディングス	5.8	11,101
三井造船	201	36,984	永大産業	13	6,552	西日本鉄道	79.3	172,318	デマトリックス	5.6	5,157
川崎重工業	447	174,330	アートネイチャー	13	6,552	ハマキョウレックス	8.3	13,138	ガンホー・オンライン・エンター	2.5	4,877
名村造船所	17.9	14,857	ダンロップスポーツ	8.5	6,060	サカイイデックス	68	36,856	GMOベイクメントゲートウェイ	119.6	29,660
日本車輛	26	7,202	バンダイナムコHDGS	4.5	4,653	近鉄グループホールディングス	4.3	9,012	インターネットインシアティブ	4.8	21,096
日産自動車	686.7	802,752	SHOEI	63.3	204,775	阪急阪神ホールディングス	2.4	6,235	さくらインターネット	8.7	15,059
いすゞ自動車	166.6	252,648	フランスベッドHDGS	27.2	8,568	南海電鉄	577	261,381	SRAホールディングス	4.8	4,579
トヨタ自動車	714.1	5,101,533	パイロントコーポレーション	3.2	7,235	京都府電鉄	72.4	272,948	コムチュア	3.5	8,519
日野自動車	81.4	97,680	萩原工業	7.8	7,144	神戸電鉄	122	73,078	朝日ネット	17.6	8,588
三菱自動車工業	211.7	139,510	トッパ・フォームズ	10.1	49,035	名古屋鉄道	129	100,491	コムチュア	1.5	4,890
エフテック	4.4	5,997	フジールインターナショナル	2.5	5,980	山陽電鉄	18	6,678	gumi	6.7	5,467
武蔵精密工業	6.7	20,602	タジラ・インターナショナル	9.1	10,592	山陽電鉄	209	119,548	LINE	9.6	38,256
日産車体	24.9	28,585	アジャール・インターナショナル	6.5	30,907	山陽電鉄	23	13,708	野村総合研究所	38.5	153,037
新明和工業	23	24,242	フジラ・インターナショナル	22.7	27,467	山陽電鉄	221	136,136	インテージホールディングス	3.7	7,322
極東開発工業	11.7	18,018	大建工業	4.5	9,360	山陽電鉄	102.6	243,315	フジ・メディア・HD	58.3	96,952
日信工業	12.3	22,730	凸版印刷	159	179,829	山陽電鉄	75	53,850	オービック	19.5	100,230
トピー工業	48	14,520	大日本印刷	164	190,404	丸全昭と運輸	22	10,340	ジャストシステム	9.9	10,345
ティラド	2.7	8,505	共同印刷	21	8,400	セノー	25.7	20,894	TD(ソフトウェア)アジア	4.7	5,452
曙ブレーキ	29.2	9,139	日本写真印刷	9.8	28,175	トナミホールディングス	16	5,504	ヤフー	412.5	182,737
タチエス	10	19,470	光村印刷	2.5	5,325	ニッコンホールディングス	19	46,398	トレンドマイクロ	30	130,200
NOK	27.7	68,252	宝印刷	4.8	7,185	福山通運	33	22,638	日本オラクル	9.3	52,638
フタバ産業	18.8	13,460	アシックス	56.8	139,160	セイノーホールディングス	39.8	52,854	フューチャー	10.2	7,456
KYB	64	35,200	ツツミ	2.7	5,329	神奈川中央交通	8	5,960	CAC HOLDINGS	6.7	6,257
大同メタル工業	7.8	9,625	ヤマハ	38.6	139,539	日立物流	12	28,812	ソフバンク・テクノ	1.6	5,064
アレス工業	31.5	17,262	河合楽器	3.2	7,600	丸和運輸機関	1.8	5,234	オービックビジネス	3	15,390
カルソニックカンセイ	40	70,480	クリナップ	8.1	7,767	九州旅客鉄道	42	129,990	伊藤忠テクノソリューション	13	38,532
太平洋洋工業	12.1	18,113	ビジョン	34.9	103,164	海運業 (0.2%)			アイティフォー	11.1	6,959
ケーヒン	12.8	26,048	キングジム	7.8	6,630	日本郵船	483	110,607	大家商会	15.3	84,915
河西工業	8.2	11,619	リングテック	13	33,371	商船三井	298	99,830	サイボウズ	12.6	5,770
アイシン精機	52.5	273,525	イトーキ	12.8	10,777	川崎汽船	216	59,616	ソフトブレーン	10.1	3,878
マツダ	181.7	370,940	任天堂	35.4	868,716	N Sユナイテッド海運	31	6,324	電通国際情報	3.9	7,215
今仙電機製作所	7.3	7,701	三菱鉛筆	4.8	30,912	飯野海運	30.7	14,521	デジタルガレージ	9.1	17,981
本田技研	516.7	1,825,501	タカラスタンダード	11.8	23,128	空運業 (0.5%)			ウェザーニューズ	2.2	7,832
スズキ	114	479,370	コクオ	29.8	40,349	ANAホールディングス	102.9	361,281	C I J	16.4	8,724
富士重工	178.4	868,986	ナカバヤシ	21	5,565	倉庫・運輸関連業 (0.2%)	1,060	342,168	WOWOW	3.1	10,137
ヤマハ発動機	81.2	226,223	グローブライド	3.5	7,105	トランコム	1.8	10,512	ネットワンシステムズ	24.5	18,448
ショーワ	16.1	12,654	岡村製作所	19.3	19,975	日新	26	9,776	アルゴグラフィックス	3.7	8,273
T B K	17.1	8,396	美津濃	30	17,520	三菱倉庫	37	61,420	マーベラス	10.3	7,848
エクセディ	7.5	24,487	電気・ガス業 (2.0%)			三井倉庫	36	61,420	エイベックス・グループHD	10.5	17,850
豊田合成	18.1	49,123	東京電力HD	487.9	261,514	三井倉庫HOLD	37	12,924	日本ユニシス	16	23,424
愛三工業	9.9	10,008	中部電力	188.7	330,225	住友倉庫	40	24,720	兼松エレクトロニクス	3.8	9,321
エフ・シー・シー	5.6	9,878	関西電力	235	317,132	渋沢倉庫	28	9,660	東京放送HD	37.5	70,125
シマノ	23.1	434,742	中国電力	78.6	115,542	東陽倉庫	28.1	8,289	日本テレビHD	51.7	108,208
テイ・エス テック	13.1	40,806	北陸電力	55.1	77,415	日本トランスシティ	19	8,094	テレビ朝日HD	15.5	34,689
ジャムコ	3.7	9,135	東北電力	143.2	222,819	スカーパーJ S A T HD	43	8,041	スカパーJ S A T HD	36.7	20,588
精密機器 (1.5%)			四国電力	51.7	64,728	上組	68	75,480	テレビ東京HD	5	11,605
デルモ	87.9	370,498	九州電力	127.3	170,200	キユーソー流通システム	2.3	5,577	ワイヤレスゲート	2.7	4,487
日機装	19.7	21,216	北海道電力	53.9	53,253	郵船ロジスティクス	5.9	7,357	コネクショ	5.2	7,696
			沖縄電力	8.5	22,771	近鉄エクスプレス	10.5	18,595	日本通信	52.4	8,960

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄 柄				2016年12月19日現在				銘柄 柄				2016年12月19日現在				銘柄 柄				2016年12月19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			
千株 千円				千株 千円				千株 千円				千株 千円				千株 千円				千株 千円			
日本電信電話 454.7 2,223,937				丸紅 556.1 375,089				あみやき亭 1.6 6,248				日本瓦斯 10.5 36,382				日本瓦斯 10.5 36,382				日本瓦斯 10.5 36,382			
KDDI 560.6 1,714,875				高島 37 7,141				ひらまつ 10.7 7,308				ロイヤルホールディングス 9.3 18,348				ロイヤルホールディングス 9.3 18,348				ロイヤルホールディングス 9.3 18,348			
光通信 6.9 75,210				長瀬産業 31.6 48,316				ゲンキー 1.2 6,936				いなげや 6.6 9,721				いなげや 6.6 9,721				いなげや 6.6 9,721			
NTTドコモ 423.4 1,148,049				蝶理 4.3 7,568				大黒天物産 1.5 7,605				島忠 14.3 44,258				島忠 14.3 44,258				島忠 14.3 44,258			
エムティーアイ 10 7,320				豊田通商 62.8 192,168				ハニーズ 6 7,350				チヨダ 6.8 18,883				チヨダ 6.8 18,883				チヨダ 6.8 18,883			
GMOインターネット 21.1 31,249				兼松 119 23,800				アルペン 4.8 10,915				ライフコーポレーション 4.5 15,412				ライフコーポレーション 4.5 15,412				ライフコーポレーション 4.5 15,412			
カドカワ 16.7 27,538				三井物産 513.1 862,521				クウォール 6.9 10,122				リンガーハット 5.8 12,748				リンガーハット 5.8 12,748				リンガーハット 5.8 12,748			
学研ホールディングス 24 7,584				日本紙パルプ 28 10,360				ジェイアイエヌ 3.9 19,968				AOKIホールディングス 10.9 16,066				AOKIホールディングス 10.9 16,066				AOKIホールディングス 10.9 16,066			
ゼンリン 7.9 15,199				日立ハイテクノロジーズ 19.6 87,906				ビックカメラ 32.5 36,660				オークワ 8 9,376				オークワ 8 9,376				オークワ 8 9,376			
松竹 37 46,287				カメイ 7.5 9,037				DCMホールディングス 32.8 33,226				コメリ 8.6 23,615				コメリ 8.6 23,615				コメリ 8.6 23,615			
東宝 37 120,065				OUGホールディングス 28 7,252				MonotaRO 20.3 48,577				青山商事 11.7 47,677				青山商事 11.7 47,677				青山商事 11.7 47,677			
東映 21 20,811				スターゼン 2.4 11,520				アークランドサービスHD 2.1 6,056				しまむら 6.6 92,862				しまむら 6.6 92,862				しまむら 6.6 92,862			
NTTデータ 35.1 204,633				山善 21.8 21,494				J.フロントリテイリング 71.5 126,841				高島屋 94 99,640				高島屋 94 99,640				高島屋 94 99,640			
DTS 6.1 15,524				住友商事 356.1 497,471				ドトール・日レスHD 9.7 20,884				松屋 13.1 14,724				松屋 13.1 14,724				松屋 13.1 14,724			
スクウェア・エニックス・HD 21.9 65,262				内田洋行 18 8,712				マツモトキヨシHLDGS 10.7 63,558				イチ・ツー・オーリテイリング 28.7 54,587				イチ・ツー・オーリテイリング 28.7 54,587				イチ・ツー・オーリテイリング 28.7 54,587			
シーエーシー 3.9 6,501				三菱商事 425.8 1,091,325				プロンコビリー 3.3 9,764				近鉄百貨店 23 8,142				近鉄百貨店 23 8,142				近鉄百貨店 23 8,142			
カブコン 13.3 33,050				第一実業 15 10,005				スタートトゥデイ 52.1 101,959				丸井グループ 59.9 109,676				丸井グループ 59.9 109,676				丸井グループ 59.9 109,676			
ジャスコ 5.9 6,259				キャノンマーケティングJPN 15.9 31,736				物語コーポレーション 1.8 7,542				アクシアル リテイリング 4.6 18,377				アクシアル リテイリング 4.6 18,377				アクシアル リテイリング 4.6 18,377			
SCSK 15.6 62,400				西華産業 23 7,981				ココカラファイン 6 26,460				232.9 399,772				232.9 399,772				232.9 399,772			
アイネス 8.6 10,810				菱洋エレクトロ 6.1 8,924				三越伊勢丹HD 112.6 155,500				イズミ 11.3 56,726				イズミ 11.3 56,726				イズミ 11.3 56,726			
TKC 5.4 16,821				ウエルシア商事 5.4 16,189				ウエルシアHD 5.7 39,729				平和堂 11.4 29,127				平和堂 11.4 29,127				平和堂 11.4 29,127			
富士ソフト 8.5 23,587				神鋼商事 3.1 7,759				クリエイトSDH 8.5 21,505				フジ 6.4 15,353				フジ 6.4 15,353				フジ 6.4 15,353			
NSD 12.5 22,687				阪和興業 56 43,176				丸善CH I H D 13.1 4,833				ヤオコー 6.5 30,095				ヤオコー 6.5 30,095				ヤオコー 6.5 30,095			
コナミホールディングス 25.6 105,728				カナデン 7.6 7,904				チムニー 2 5,782				ゼビオホールディングス 7.5 13,912				ゼビオホールディングス 7.5 13,912				ゼビオホールディングス 7.5 13,912			
福井コンピュータHLD S 2 4,814				菱電商事 11 8,107				ジョイフル本田 9.2 28,704				ケースホールディングス 25.7 53,944				ケースホールディングス 25.7 53,944				ケースホールディングス 25.7 53,944			
JBCCホールディングス 15 11,325				岩谷産業 61 38,857				鳥貴族 1.6 3,803				アインホールディングス 6.9 54,786				アインホールディングス 6.9 54,786				アインホールディングス 6.9 54,786			
ミロク情報サービス 4.7 8,163				すてきなナイスグループ 45 6,930				鳥貴族 1.6 3,803				アインホールディングス 6.9 54,786				アインホールディングス 6.9 54,786				アインホールディングス 6.9 54,786			
ソフトバンクグループ 255.1 1,995,392				三菱石油 16 14,080				すかいらく 24.1 38,487				元気寿司 2.6 5,478				元気寿司 2.6 5,478				元気寿司 2.6 5,478			
卸売業 (4.4%)				稲畑産業 13.4 17,058				綿半ホールディングス 3.3 5,362				188.7 117,937				188.7 117,937				188.7 117,937			
エレマテック 2.6 4,888				ワキタ 12.5 12,400				ユナイテッド・スーパーマケ 18.2 17,817				アークランドサカモト 10 14,850				アークランドサカモト 10 14,850				アークランドサカモト 10 14,850			
あらた 2.9 7,322				東邦ホールディングス 18 43,056				ブックオフコーポレーション 8.8 7,075				ニトリホールディングス 24.6 318,078				ニトリホールディングス 24.6 318,078				ニトリホールディングス 24.6 318,078			
フィールズ 4.7 6,829				サンゲツ 19.2 39,456				あさひ 4.9 6,551				吉野家ホールディングス 19.1 30,082				吉野家ホールディングス 19.1 30,082				吉野家ホールディングス 19.1 30,082			
双日 330.2 97,739				ミツウロコグループ 9.6 6,902				日本調剤 2.1 10,027				松屋 フーズ 2.8 10,850				松屋 フーズ 2.8 10,850				松屋 フーズ 2.8 10,850			
アルレッサホールディングス 66.9 132,194				シナネホールディングス 2.8 5,863				コスモ薬品 2.9 61,538				サガミチェーン 8.5 10,922				サガミチェーン 8.5 10,922				サガミチェーン 8.5 10,922			
横浜冷凍 14.7 15,111				伊藤忠エネクス 12.1 11,289				一六堂 22.4 8,265				関西スーパーマーケット 5.7 8,584				関西スーパーマーケット 5.7 8,584				関西スーパーマーケット 5.7 8,584			
山下医科器械 3.3 5,722				サシリオ 17.1 38,765				セブン&アイ・HLDGS 237.2 1,089,934				王将フードサービス 4.1 17,363				王将フードサービス 4.1 17,363				王将フードサービス 4.1 17,363			
アルコニック 5.2 9,084				リョサン 8.2 28,823				薬王堂 3.3 7,187				アレキス 6.1 13,883				アレキス 6.1 13,883				アレキス 6.1 13,883			
神戸物産 3.2 12,432				新光ホールディングス 7.8 9,609				クリエイト・レストランツ・ホール 15.6 16,021				ミニストップ 4.1 8,364				ミニストップ 4.1 8,364				ミニストップ 4.1 8,364			
あいホールディングス 10.3 23,514				ツルハホールディングス 13.1 149,078				ツルハホールディングス 13.1 149,078				アークス 10.4 27,861				アークス 10.4 27,861				アークス 10.4 27,861			
ディー・ブイエックス 3.7 5,087				サンマルクホールディングス 3.7 13,024				サンマルクホールディングス 3.7 13,024				パローホールディングス 12.2 37,149				パローホールディングス 12.2 37,149				パローホールディングス 12.2 37,149			
ダイワボウHD 49 14,357				トリドールホールディングス 7.1 17,025				ベルク 7.1 17,025				ベルク 2.7 12,406				ベルク 2.7 12,406				ベルク 2.7 12,406			
マツコ・富士ELHLDGS 10.5 15,571				ダユー・リッツHLDGS 9.5 6,602				タイユー・リッツHLDGS 9.5 6,602				大庄 4.4 6,956				大庄 4.4 6,956				大庄 4.4 6,956			
バイタルKSKHD 10.6 10,472				クスのアオキHLDGS 5.2 26,988				ファーストリテイリング 9.5 409,735				ファーストリテイリング 9.5 409,735				ファーストリテイリング 9.5 409,735				ファーストリテイリング 9.5 409,735			
UKCホールディングス 4 8,652				総合メディアカル 3 13,170				サンドラッグ 10.9 88,617				サンドラッグ 10.9 88,617				サンドラッグ 10.9 88,617				サンドラッグ 10.9 88,617			
TOKAIホールディングス 25.2 19,504				ノジマ 6.8 8,744				サックスパーホールディン 6.3 7,560				サックスパーホールディン 6.3 7,560				サックスパーホールディン 6.3 7,560				サックスパーホールディン 6.3 7,560			
三洋貿易 5 7,695				キャパ・フリエイト 8.8 11,360				ペルナ 15 10,245				ペルナ 15 10,245				ペルナ 15 10,245				ペルナ 15 10,245			
ウイン・パートナーズ 3 5,835				ライトオン 5.1 5,508				銀行業 (8.8%)				銀行業 (8.8%)				銀行業 (8.8%)				銀行業 (8.8%)			
シップヘルスケアHD 10.7 32,207				良品計画 7.5 168,900				じもとホールディングス 49.7 10,337				じもとホールディングス 49.7 10,337				じもとホールディングス 49.7 10,337				じもとホールディングス 49.7 10,337			
コメダホールディングス 7.7 13,829				アドヴァン 6.7 8,053				めぶきフィナンシャルG 272.4 122,852				めぶきフィナンシャルG 272.4 122,852				めぶきフィナンシャルG 272.4 122,852				めぶきフィナンシャルG 272.4 122,852			
小野建 5.8 7,917				アスビ 2.2 7,139				東京TYフィナンシャルG 8.2 35,834				東京TYフィナンシャルG 8.2 35,834				東京TYフィナンシャルG 8.2 35,834				東京TYフィナンシャルG 8.2 35,834			
佐島電機 8.9 6,594				コナカ 12.5 7,450				九州フィナンシャルG 92.4 77,246				九州フィナンシャルG 92.4 77,246				九州フィナンシャルG 92.4 77,246				九州フィナンシャルG 92.4 77,246			
伯東 5.5 5,670				コーナン商事 7.9 17,814				ゆうちょ銀行 161 237,153				ゆうちょ銀行 161 237,153				ゆうちょ銀行 161 237,153				ゆうちょ銀行 161 237,153			
コンドレーテック 8.3 7,021				ワタミ 7.2 7,848				富士第一銀行 15.9 9,015				富士第一銀行 15.9 9,015				富士第一銀行 15.9 9,015				富士第一銀行 15.9 9,015			
ナガイレーベン 8.5 21,284				ドンキホーテホールディン 36.7 160,379				コンコリア・フィナンシャル 370 216,450				コンコリア・フィナンシャル 370 216,450				コンコリア・フィナンシャル 370 216,450				コンコリア・フィナンシャル 370 216,450			
三菱食品 6.1 20,923				西松屋チェーン 10.2 14,953				西日本フィナンシャルHD 37.6 44,593				西日本フィナンシャルHD 37.6 44,593				西日本フィナンシャルHD 37.6 44,593				西日本フィナンシャルHD 37.6 44,593			
松田産業 4.8 7,296				ゼンショーホールディングス 29.1 55,581				新生銀行 536 109,880				新生銀行 536 109,880				新生銀行 536 109,880				新生銀行 536 109,880			
第一興商 9.1 41,314				幸楽苑ホールディングス 5.7 9,302				あおぞら銀行 356 152,012				あおぞら銀行 356 152,012				あおぞら銀行 356 152,012				あおぞら銀行 356 152,012			
メディアパルHD 56.5 102,604				サイゼリヤ 9.3 24,942				三菱UFJフィナンシャルG 4,294.8 3,262,330				三菱UFJフィナンシャルG 4,294.8 3,262,330				三菱UFJフィナンシャルG 4,294.8 3,262,330				三菱UFJフィナンシャルG 4,294.8 3,262,330			
秋原電気 3.3 6,976				VTホールディングス 20.2 12,059				リソナホールディングス 663 420,342				リソナホールディングス 663 420,342				リソナホールディングス 663 420,342				リソナホールディングス 663 420,342			
アズワン 4.5 22,635				ポプラ 11.4 5,722				三井住友トラストHD 118.4 542,390				三井住友トラストHD 118.4 542,390				三井住友トラストHD 118.4 542,390				三井住友トラストHD 118.4 542,390			
シモジマ 6.2 7,012				ユナイテッドアローズ 7.7 25,602				三井住友フィナンシャルG 453.5 2,129,182				三井住友フィナンシャルG 453.5 2,129,182				三井住友フィナンシャルG 453.5 2,129,182				三井住友フィナンシャルG 453.5 2,129,182			
ドウシシャ 7.1 14,519				ハイデイド日高 5.4 14,493				第四銀行 68 36,924				第四銀行 68 36,924				第四銀行 68 36,924				第四銀行 68 36,924			
小津産業 2.6 5,473				京都きもの友禅 10.7 9,961				北越銀行 6.1 16,396				北越銀行 6.1 16,396				北越銀行 6.1 16,396				北越銀行 6.1 16,396			
黒田電気 7.7 18,256				コロワイド 18.6 35,191				千葉銀行 217 163,401				千葉銀行 217 163,401				千葉銀行 217 163,401				千葉銀行 217 163,401			
丸文 8.2 5,740				香番屋 5.1 19,278				群馬銀行 124.2 82,841				群馬銀行 124.2 82,841				群馬銀行 124.2 82,841				群馬銀行 124.2 82,841			
ハピネット 5.8 7,505				スキールホールディングス 12.4 68,944				武蔵野銀行 8.4 28,812				武蔵野銀行 8.4 28,812				武蔵野銀行 8.4 28,812				武蔵野銀行 8.4 28,812			
日本ライフライン 5 11,720				スクローール 12.1 4,343				千葉興業銀行 18.8 11,392				千葉興業銀行 18.8 11,392				千葉興業銀行 18.8 11,392				千葉興業銀行 18.8 11,392			
エクセル 3.4 5,100				ヨドンホールディングス 4.5 11,155				筑波銀行 28.9 10,606				筑波銀行 28.9 10,606				筑波銀行 28.9 10,606				筑波銀行 28.9 10,606			
マルカキカイ 3.5 5,418				ユニ・ファミリーマートHD 24.9 189,738				七十七銀行 86 52,288				七十七銀行 86 52,288				七十七銀行 86 52,288				七十七銀行 86 52,288			
I DOM 16.5 11,302				木曾路 7.1 16,670				青森銀行 45 17,865				青森銀行 45 17,865				青森銀行 45 17,865				青森銀行 45 17,865			
進和 4.5 7,681				サトレストランシシステムズ 9.4 7,642				山形銀行 37 14,467				山形銀行 37 14,467				山形銀行 37 14,467				山形銀行 37 14,467			
シークス 4.1 16,133				千趣会 11.4 8,504				秋田銀行 32 16,032				秋田銀行 32 16,032				秋田銀行 32 16,032				秋田銀行 32 16,032			
伊藤忠 415.5 662,307				ケーヨー 12.1 6,667				岩手銀行 3.5 17,062				岩手銀行 3.5 17,062				岩手銀行 3.5 17,062				岩手銀行 3.5 17,062			
				上新電機 14 14,000				東邦銀行 48 21,504				東邦銀行 48 21,504				東邦銀行 48 21,504				東邦銀行 48 21,504			

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
東北銀行	千株	千円	カブドットコム証券	千株	千円	トーセイ	千株	千円	アサンテ	千株	千円
みちのく銀行	64	9,920	極東証券	39.8	16,119	エス・ティ・ティ都市開発	9.3	7,877	N・フィールド	3.6	6,134
ふくおかフィナンシャルG	33	7,359	岩井コスモホールディング	7.5	13,492	サンフロンティア不動産	34.5	37,708	リクルートホールディングス	3.8	5,316
静岡銀行	228	126,540	監理証券	7.5	8,602	エフ・ジェー・ネクスト	6.5	6,571	日本郵政	131.1	595,849
十六銀行	153	157,437	マネーパートナーズGP	12.7	8,661	サンプラザホールディング	8.1	5,953	ベルシス24HLDGS	156.4	241,638
スルガ銀行	74	32,042	保険業 (2.7%)	8.6	4,962	日本空港ビルデング	13.2	5,266	リログループ	9.7	9,321
八十二銀行	57.9	158,588	かんぽ生命保険	21.6	55,792	サービスマ (3.6%)	18.1	81,902	東洋	2.3	35,397
山梨中央銀行	106.4	75,756	SOMPOホールディングス	118.2	474,809	日本工営	21	11,046	エイチ・アイ・エス	1.5	7,447
大垣共立銀行	34	19,788	ANICOMホールディングス	4.1	9,483	ネクスト	15.7	12,246	共立メンテナンス	9.9	31,036
福井銀行	75	35,250	MS & AD	168.9	625,267	ジェイエイリクルートメント	4.3	5,594	イチネンホールディングス	4.9	33,957
北國銀行	57	23,712	SONY F H	54.1	101,708	日本M&Aセンター	17.5	54,337	建設技術研究所	8.7	10,057
清水銀行	2.4	8,880	第一生命HLDGS	341.4	700,552	アコーディア・ゴルフ	18.9	22,736	建設技術研究所	6.2	6,702
滋賀銀行	49	32,487	東京海上HD	229.4	1,151,817	タケイ	6.8	6,188	東京デタル	6.0	9,540
南都銀行	5.4	24,516	T & Dホールディングス	205.8	327,222	トラスト・テック	3.3	5,233	タナベ経営	3.7	4,739
百五銀行	49	24,108	アドバンスクリエイト	3	5,400	パソナグループ	6.1	4,916	ナガワ	1.2	5,082
京都銀行	100	92,700	その他金融業 (1.3%)			CD S	8	8,312	よみうりランド	15	7,425
紀陽銀行	21.5	41,129	全国保証	16.2	61,155	リングアンドモチベーション	16.4	6,691	東京都競馬	43	12,298
三重銀行	3.8	9,321	クレディセゾン	42.8	92,105	G C A	6.4	5,913	常磐興産	5.2	8,070
ほくほくフィナンシャルG	37.1	77,910	芙蓉総合リース	6.4	36,416	エス・エム・エス	8.5	21,607	カナモト	8.4	26,082
広島銀行	166	96,446	興銀リース	10.6	28,217	デンパホールディングス	46.8	81,712	東京ドーム	24.2	28,241
山陰合同銀行	33.7	33,531	東京生計チューリー	11.2	44,800	リニカル	4.1	5,186	西尾レントオール	4.9	16,758
中国銀行	39.2	67,776	日本証券金融	25.2	16,506	クックパッド	14.1	15,792	トランス・コスモス	7.1	19,340
鳥取銀行	4.2	7,992	アイフル	96.3	34,475	スタジオアリス	2.9	6,626	乃村工藝社	13	21,684
伊予銀行	59.2	50,852	リコーリース	4.5	16,627	シミックホールディングス	4	5,944	藤田観光	22	7,898
百十四銀行	60	24,480	イオンフィナンシャルサービス	36.3	76,556	総合警備保障	21.9	98,440	KNT-CTホールディングス	42	6,006
四国銀行	44	12,672	アコム	116.3	61,057	カクコム	43.4	79,595	日本管財	5.5	9,845
阿波銀行	46	33,396	ジャックス	33	17,985	ルネサンス	4.7	6,730	トーカイ	2.9	11,629
大分銀行	33	14,652	オリコ	125.5	27,359	ディップ	8	18,912	セコム	62.2	528,886
宮崎銀行	39	14,352	日立キャピタル	13.4	39,221	オプトホールディング	7.7	5,651	セントラル警備保障	3.3	6,527
佐賀銀行	36	10,908	オリックス	401.6	749,385	新日本科学	7.7	4,596	丹青社	11.6	9,651
沖縄銀行	36	12,852	三菱UFJ リリース	144.4	88,950	ツクイ	15.7	11,366	メイテック	7.1	30,423
十八銀行	5.6	24,612	日本取引所グループ	176.7	310,108	エスリー	52.5	146,055	アサソー ディ・ケイ	9.6	28,377
琉球銀行	12.1	19,251	イー・ギャランティ	2.4	5,757	アウトソーシング	3.3	11,764	応用地質	6.3	8,511
セブン銀行	211.8	75,612	NECキャピタルリレーション	2.9	5,388	ウェルネット	5.4	6,852	船井総研ホールディング	8.3	14,848
みずほフィナンシャルG	7,686.4	1,697,925	不動産業 (2.6%)			ディー・エヌ・エー	27.1	71,489	学究社	4.7	6,594
高知銀行	68	9,316	いちご	54.1	24,020	博報堂D Y H L D G S	83.3	116,620	ベネッセホールディングス	20.2	66,458
山口フィナンシャルG	51	66,810	日本駐車場開発	74.1	12,448	ぐるなび	8.9	20,327	イオンディライト	6.6	21,351
長野銀行	3.2	6,496	ヒューリック	118.3	126,226	エスアールジータカミヤ	8.5	5,227	ニチイ学館	11.2	9,923
名古屋銀行	4.5	19,440	野村不動産HLDGS	36.9	73,910	ファンコミュニケーションズ	20.3	5,034	ダイセキ	10.4	23,774
北洋銀行	88.9	44,894	三重交通グループHD	1.2	4,704	ティア	15.7	11,508	計 株数、金額	86,782	129,800,710
愛知銀行	2	14,060	サンティ	5.6	6,076	インフォーマット	9.9	6,365	銘柄数<比率>	1,501	銘柄数<99.7%>
第三銀行	4.4	8,162	日本商業開発	3.6	7,160	J P ホールディングス	13.3	16,917	(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価		
中京銀行	2.7	6,409	プレナスコーポレーション	9.5	14,250	E P S ホールディングス	21.8	5,689	総額に対する各業種の比率。		
大光銀行	30	8,100	ユニツホールディングス	4.9	15,900	プレスステージ・インター	7.7	10,341	(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額		
愛媛銀行	5.2	7,280	日本管理センター	4.7	6,288	アミューズ	9.8	7,173	に対する評価額の比率。		
トマト銀行	5	8,340	オーブハウスHD	11	6,820	ドリームイクスベータ	3.8	6,562	(注3) 評価額の単位未満は切捨て。		
みなと銀行	5.1	10,735	東急不動産HD	8.3	23,347	クイック	2.1	4,265			
京葉銀行	42	22,638	飯田GHD	134.4	95,020	ケネディクス	4.4	4,448			
関西アーバン銀行	7.5	11,392	パーク24	47	106,408	イオンファンタジー	80.5	34,454			
栃木銀行	31.8	18,952	バラカ	28.7	87,391	電通	66.9	381,999			
北日本銀行	2.5	7,862	三井不動産	2.7	5,275	イオンファンタジー	1.9	5,738			
東和銀行	117	13,104	三菱地所	301	826,847	みからホールディングス	4.9	5,718			
福島銀行	91	8,918	平和不動産	422	985,792	アルプス技研	15.2	78,888			
大東銀行	43	7,310	東京建物	10.9	17,636	オリエンタルランド	2.9	7,273			
トモニホールディングス	45.4	29,101	ダイビル	64.8	100,699	ダスキン	65.1	435,063			
フィデアホール	58.8	12,936	京阪神ビルディング	14.7	15,214	光明ネットワークジャパン	14.8	34,395			
池田泉州HD	56.7	31,638	住友不動産	11.5	7,049	ファルコホールディングス	9	9,594			
証券、商品先物取引業 (1.3%)			大京	136	428,400	ライゾートトラスト	6.4	9,305			
F P G	21	19,614	テオオーシー	104	25,480	ビー・エム・エル	19.4	15,326			
S B I ホールディングス	64	98,048	東京楽天地	22.1	20,332	りらひらコミュニケーション	23.3	51,236			
ジャフコ	9.5	37,097	レオパレス21	13	6,682	リソー教育	7.9	22,191			
大和証券G本社	527	400,045	スターツコーポレーション	70.1	43,181	ユー・エス・エス	10.3	11,288			
野村ホールディングス	1,159.8	853,380	フジ住宅	5.9	11,652	サイバーエージェント	11.5	6,578			
岡三証券グループ	45	33,660	空港施設	9.2	6,881	デー・オー・ダブリュ	72.5	134,560			
丸三証券	18.2	18,709	住友不動産販売	9.7	5,596	セントラルスポーツ	31.7	86,002			
東洋証券	30	8,490	ゴールドフレスト	4.9	14,116	フルキャストホールディングス	307.7	353,085			
東海東京HD	62	40,486	日神不動産	5.2	11,122	テクノロ	8	5,296			
光世証券	29	5,771	タカラレバン	11.9	6,556	ジャパンマテリアル	3.1	8,639			
水戸証券	26.8	9,460	サンヨーハウジング 名古屋	25.4	17,322	ベクトル	7.1	6,524			
いちよし証券	13.4	12,676	イオンモール	6.6	7,029		9.9	35,986			
松井証券	29.6	30,044	ファースト住建	36.1	62,308		2.4	8,616			
マネックスG	60.9	20,645		3.5	5,243		5.6	6,042			

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別		2016年12月19日現在	
		買建額	売建額
国内	TOPIX	百万円 309	百万円 1

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付および借入の状況

区 分	2016年12月19日現在	
	貸 付	借 入
株式	株	株
	2,731,700 (1,733,400)	一 (一)

(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1,733,400株を貸付しています。

外国株式インデックスマザーファンド

＜補足情報＞

当ファンド（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050）が投資対象としている「外国株式インデックスマザーファンド」の決算日（2016年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年12月19日）現在における外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を19～31ページに併せて掲載いたしました。

■外国株式インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2016年5月13日から2016年12月19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
		千株	千円	円			千株	千円	円
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR (イスラエル)		20.9	100,444	4,805	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD (イスラエル)		20.6	96,915	4,704
FACEBOOK INC-A (アメリカ)		3.55	44,915	12,652	APPLE INC (アメリカ)		2.7	34,115	12,635
APPLE INC (アメリカ)		3.8	41,336	10,878	YUM CHINA HOLDINGS INC (アメリカ)		9.4	28,191	2,999
AMAZON.COM INC (アメリカ)		0.51	40,084	78,597	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP (アメリカ)		4	25,539	6,384
NXP SEMICONDUCTORS NV (オランダ)		3.8	38,493	10,129	GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)		5.5	19,433	3,533
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)		4.1	37,534	9,154	PROCTER & GAMBLE CO/THE (アメリカ)		2	18,762	9,381
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)		2.75	33,519	12,189	AMERICAN EXPRESS CO (アメリカ)		2.4	17,502	7,292
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS (イギリス)		11.9	32,116	2,698	NESTLE SA-REG (スイス)		2.2	16,854	7,661
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)		0.39	30,493	78,187	GILEAD SCIENCES INC (アメリカ)		1.9	16,807	8,845
AT&T INC (アメリカ)		7.2	30,080	4,177	ABB LTD-REG (スイス)		6.5	14,573	2,242

(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12月19日現在における外国株式インデックスマザーファンド（40,367,016千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘 柄	2016年12月19日現在				業 種 等
	株 数	評 価 額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円		
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	27	176	20,796	情報技術	
PALO ALTO NETWORKS INC	21	271	31,945	情報技術	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	14.5	152	17,975	ヘルスケア	
SYNCHRONY FINANCIAL	196	717	84,452	金融	
ABBOTT LABORATORIES	341	1,299	152,826	ヘルスケア	
ARCONIC INC	103.33	209	24,625	資本財・サービス	
VERISK ANALYTICS INC	37.5	306	36,074	資本財・サービス	
LAS VEGAS SANDS CORP	101	575	67,731	一般消費財・サービス	
AMPHENOL CORP-CL A	72	485	57,083	情報技術	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	71.79	550	64,719	情報技術	
QORVO INC	32	175	20,586	情報技術	
AFLAC INC	93	645	75,931	金融	
DARDEN RESTAURANTS INC	27.5	207	24,432	一般消費財・サービス	
ADOBE SYSTEMS INC	114.5	1,185	139,467	情報技術	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	50	147	17,338	素材	
LULULEMON ATHLETICA INC	25	166	19,532	一般消費財・サービス	
PEOPLES UNITED FINANCIAL	68	129	15,285	金融	
GARMIN LTD	26	127	14,983	一般消費財・サービス	
AETNA INC	80.79	1,024	120,511	ヘルスケア	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	47.5	700	82,375	素材	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	166	1,931	227,250	資本財・サービス	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	37.51	187	22,101	情報技術	
VR BERKLEY CORP	21	137	16,231	金融	
AUTOZONE INC	6.7	532	62,633	一般消費財・サービス	

銘 柄	2016年12月19日現在				業 種 等
	株 数	評 価 額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
DOLLAR TREE INC	55.71	469	55,177	一般消費財・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	209	763	89,758	ヘルスケア	
PINNACLE WEST CAPITAL	26.5	203	23,899	公益事業	
CELANESE CORP-SERIES A	33	269	31,694	素材	
DR HORTON INC	79.66	223	26,274	一般消費財・サービス	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	21	109	12,914	エネルギー	
DENTSPLY SIRONA INC	55	330	38,869	ヘルスケア	
AUTODESK INC	45.5	347	40,933	情報技術	
MOODY'S CORP	40.5	390	45,958	金融	
DEVON ENERGY CORP	109	516	60,749	エネルギー	
ALBEMARLE CORP	26	231	27,289	素材	
ATMOS ENERGY CORP	23	170	20,063	公益事業	
ALLIANT ENERGY CORP	50	188	22,120	公益事業	
CITIGROUP INC	661.23	3,950	464,738	金融	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	106	1,069	125,747	情報技術	
AMERICAN ELECTRIC POWER	115	722	84,965	公益事業	
ALLEGHANY CORP	3.5	210	24,806	金融	
DUN & BRADSTREET CORP	9	108	12,707	資本財・サービス	
DOMINO'S PIZZA INC	11	176	20,708	一般消費財・サービス	
HESS CORP	65	406	47,787	エネルギー	
DAVITA INC	38	246	29,027	ヘルスケア	
DANAHER CORP	142.5	1,128	132,790	ヘルスケア	
FORTIVE CORP	72	394	46,437	資本財・サービス	
AVNET INC	28	134	15,812	情報技術	

銘柄	株数	2016年12月19日現在		業種等
		評価額	価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	135	781	91,977	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	140	121	14,299	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	40.28	102	12,072	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	134	623	73,311	生活必需品
BUNGE LTD	31	225	26,557	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	82.25	573	67,473	情報技術
APPLE INC	1,232	14,287	1,680,639	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	94	673	79,269	金融
BOEING CO/THE	135	2,085	245,346	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	34.65	262	30,834	金融
SPECTRA ENERGY CORP	159.96	668	78,632	エネルギー
BECTON DICKINSON AND CO	48.87	819	96,432	ヘルスケア
CDK GLOBAL INC	29	172	20,324	情報技術
NISOURCE INC	73	160	18,917	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	33.5	244	28,809	資本財・サービス
CR BARD INC	16.8	371	43,679	ヘルスケア
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	242.71	1,154	135,783	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	936.04	4,892	575,526	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	275.5	4,539	533,938	金融
ANSYS INC	21	199	23,494	情報技術
H&R BLOCK INC	51	119	14,067	一般消費財・サービス
BB&T CORP	190	885	104,127	金融
BAKER HUGHES INC	95.73	635	74,759	エネルギー
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	380.5	2,230	262,372	ヘルスケア
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	13	97	11,467	生活必需品
JPMORGAN CHASE & CO	826.7	7,021	825,996	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	56	429	50,563	金融
CIGNA CORP	59	806	94,913	ヘルスケア
LKQ CORP	68	220	25,940	一般消費財・サービス
COMPUTER SCIENCES CORP	33	198	23,380	情報技術
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	10	129	15,230	金融
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	258.42	91	10,821	電気通信サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	50	226	26,678	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	69	176	20,729	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	36.6	408	48,102	金融
DOLLAR GENERAL CORP	65	501	58,950	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	38	295	34,802	情報技術
CATERPILLAR INC	134	1,240	145,928	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	64	265	31,242	公益事業
MOSAIC CO/THE	75.5	223	26,252	素材
DELTA AIR LINES INC	44	220	25,961	資本財・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	43.5	312	36,770	生活必需品
CORNING INC	235	571	67,172	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,144	3,499	411,645	情報技術
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	200	1,497	176,115	素材
MORGAN STANLEY	325	1,388	163,279	金融
WABCO HOLDINGS INC	12.5	135	15,915	資本財・サービス
DOW CHEMICAL CO/THE	258	1,506	177,265	素材
MSCI INC	22	175	20,677	金融
MIDDLEBY CORP	13	172	20,274	資本財・サービス
COTY INC-CL A	111.39	208	24,489	生活必需品
BROADCOM LTD	90.62	1,616	190,189	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	10.5	151	17,852	ヘルスケア
DICK'S SPORTING GOODS INC	20	113	13,400	一般消費財・サービス
ACUITY BRANDS INC	10	248	29,191	資本財・サービス
ARAMARK	53.5	194	22,838	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	49	132	15,620	素材
DTE ENERGY COMPANY	42	412	48,515	公益事業

銘柄	柄	2016年12月19日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
CENTENE CORP		40	226	26,593	ヘルスケア
CITIZENS FINANCIAL GROUP		122	430	50,687	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO		40.5	208	24,558	金融
GARTNER INC		19	196	23,131	情報技術
SPLUNK INC		29	160	18,901	情報技術
WHITEWAVE FOODS CO		41	227	26,704	生活必需品
AGCO CORP		17	98	11,644	資本財・サービス
DOMINION RESOURCES INC/VA		143	1,084	127,621	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP		93	413	48,681	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP		34	164	19,401	資本財・サービス
DEERE & CO		62	630	74,214	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC		36	253	29,765	情報技術
TIME WARNER INC		176.33	1,671	196,631	一般消費財・サービス
VMWARE INC-CLASS A		19	153	18,056	情報技術
TEGNA INC		45	99	11,714	一般消費財・サービス
NASDAQ INC		27	183	21,615	金融
TARGA RESOURCES CORP		40	219	25,840	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		15	188	22,217	金融
CONSOLIDATED EDISON INC		70	508	59,845	公益事業
MEDNAX INC		20	130	15,350	ヘルスケア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP		26	201	23,717	一般消費財・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		21	203	23,961	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO		194.5	1,288	151,527	生活必需品
AMETEK INC		52.25	256	30,226	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC		58	260	30,674	生活必需品
LYONDELLBASELL INDU-CL A		80	709	83,451	素材
COSTCO WHOLESALE CORP		99.5	1,596	187,746	生活必需品
SCANIA CORP		31	229	26,995	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP		12	178	20,960	金融
WR GRACE & CO		16	107	12,608	素材
VALSPAR CORP/THE		17	177	20,900	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		7	274	32,283	一般消費財・サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP		76	178	20,972	金融
UGI CORP		39	176	20,722	公益事業
CUMMINS INC		37	500	58,908	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC		136	495	58,343	情報技術
SABRE CORP		46	116	13,754	情報技術
CDW CORP/DE		35.5	187	22,069	情報技術
SIGNATURE BANK		13	189	22,280	金融
AMERCO		1.7	62	7,398	資本財・サービス
HANESBRANDS INC		85	183	21,546	一般消費財・サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC		122	335	39,507	一般消費財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC		18	183	21,586	エネルギー
ALIGN TECHNOLOGY INC		17	171	20,225	ヘルスケア
TRANSIGM GROUP INC		12	301	35,497	資本財・サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A		29.5	300	35,318	電気通信サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC		85	366	43,133	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC		439.81	938	110,402	エネルギー
HCA HOLDINGS INC		71	526	61,936	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP		105.5	229	27,041	エネルギー
T-MOBILE US INC		67.5	384	45,266	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C		25	94	11,066	情報技術
COCA-COLA CO/THE		937.5	3,913	460,300	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC		40	215	25,384	資本財・サービス
EATON VANCE CORP		25	102	12,092	金融
FMC TECHNOLOGIES INC		49	171	20,115	エネルギー
FRANKLIN RESOURCES INC		87	341	40,198	金融
CSX CORP		214	771	90,722	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	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	外貨建金額	評価価額 邦貨換算金額	
FLUOR CORP	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LABORATORY CORP OF AMER HLDGS	33	181	21,338	資本財・サービス
EXPEDIA INC	23.5	300	35,316	ヘルスケア
AUTOLIV INC	28.75	335	39,452	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	20	217	25,584	一般消費財・サービス
FLOWSERVE CORP	92.1	6,979	820,947	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	29	139	16,442	資本財・サービス
EXXON MOBIL CORP	49	447	52,676	ヘルスケア
FLIR SYSTEMS INC	946.05	8,626	1,014,686	エネルギー
AES CORP	31	112	13,207	情報技術
L3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	156	183	21,561	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	18	283	33,316	資本財・サービス
EOG RESOURCES INC	10	214	25,208	金融
EQT CORP	126.5	1,315	154,754	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	40.5	263	30,999	エネルギー
AMERISOURCEBERGEN CORP	42	282	33,194	情報技術
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44	340	40,049	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	77.9	357	42,069	ヘルスケア
MACY'S INC	851.23	1,075	126,464	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	73.98	277	32,607	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	34.4	97	11,487	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	62.87	191	22,541	一般消費財・サービス
MOBILEYE NV	58.2	160	18,840	一般消費財・サービス
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	39	138	16,308	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	3	31	3,722	ヘルスケア
FORTINET INC	38	161	18,970	資本財・サービス
MARTEL CORP	31	92	10,855	情報技術
NEXTERA ENERGY INC	3.2	283	33,336	金融
FREEMONT-MCMORAN INC	105.5	1,254	147,554	公益事業
UNITED RENTALS INC	271.08	374	44,099	素材
F5 NETWORKS INC	395	2,043	240,403	金融
FASTENAL CO	19	200	23,625	資本財・サービス
FISERV INC	16	231	27,222	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	65	312	36,738	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	52	556	65,467	情報技術
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	2,056	6,527	767,865	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	36.5	161	18,947	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	61.5	198	23,395	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	319	1,160	136,474	一般消費財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27.5	130	15,323	一般消費財・サービス
ALPHABET INC-CL A	59	1,029	121,043	資本財・サービス
ALPHABET INC-CL C	83	1,982	233,244	金融
GENERAL MILLS INC	67.6	5,474	643,967	情報技術
FIRSTENERGY CORP	70.97	5,612	660,175	情報技術
GENUINE PARTS CO	136	863	101,585	生活必需品
IHS MARKIT LTD	99.68	316	37,263	公益事業
FIFTH THIRD BANCORP	35	342	40,338	一般消費財・サービス
HARRIS CORP	82.34	286	33,667	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	175	469	55,168	金融
HALLIBURTON CO	29.5	306	36,088	情報技術
HOME DEPOT INC	30	142	16,808	資本財・サービス
ASSURANT INC	197.5	1,066	125,429	エネルギー
HUNTINGTON BANCSHARES INC	281.5	3,803	447,387	一般消費財・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	14	127	15,042	金融
HERSHEY CO/THE	246	320	37,675	金融
HARLEY-DAVIDSON INC	11	200	23,601	資本財・サービス
HUMA INC	33	333	39,268	生活必需品
NXP SEMICONDUCTORS NV	40	236	27,840	一般消費財・サービス
	35	719	84,663	ヘルスケア
	68	660	77,740	情報技術

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	外貨建金額	評価価額 邦貨換算金額	
HELMERICH & PAYNE	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HENRY SCHEIN INC	26	204	24,069	エネルギー
HP INC	19	292	34,364	ヘルスケア
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	389	585	68,865	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	377	885	104,169	情報技術
HOLLYFRONTIER CORP	45	154	18,150	一般消費財・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	39	123	14,579	エネルギー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	21	72	8,564	一般消費財・サービス
HARMAN INTERNATIONAL	28	243	28,598	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	16	177	20,877	一般消費財・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	139.53	1,206	141,906	生活必需品
INTERNATIONAL PAPER CO	207	3,451	405,977	情報技術
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	91	489	57,535	素材
ZOETIS INC	36	198	23,400	資本財・サービス
INGERSOLL-RAND PLC	107	561	66,028	ヘルスケア
CHENIERE ENERGY INC	60.29	465	54,707	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	47	201	23,662	エネルギー
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	31	154	18,145	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC LIAC - C	145.23	429	50,566	一般消費財・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	24.37	51	6,088	一般消費財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	41.05	318	37,432	資本財・サービス
JM SMUCKER CO/THE	82	232	27,326	情報技術
JOHNSON & JOHNSON	27.2	351	41,318	生活必需品
ABBVIE INC	624	7,230	850,572	ヘルスケア
HOLOGIC INC	373.79	2,325	273,574	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	57.5	230	27,115	ヘルスケア
KROGER CO	83.5	970	114,172	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	205	736	86,666	生活必需品
LOCKHEED MARTIN CORP	37	289	34,030	情報技術
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	60	1,500	176,501	資本財・サービス
L BRANDS INC	21	310	36,569	情報技術
LOWE'S COS INC	56	388	45,702	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	201	1,466	172,503	一般消費財・サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	227.5	1,667	196,183	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	69	391	46,028	電気通信サービス
RANGE RESOURCES CORP	37	386	45,459	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	43	147	17,344	エネルギー
LOEWS CORP	10	100	11,815	不動産
LINCOLN NATIONAL CORP	65	308	36,310	金融
MCDONALD'S CORP	54.49	361	42,553	金融
3M CO	194	2,390	281,236	一般消費財・サービス
FACEBOOK INC-A	139	2,466	290,140	資本財・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	531.5	6,371	749,431	情報技術
MANPOWERGROUP INC	52.54	296	34,881	情報技術
S&P GLOBAL INC	17	153	18,083	資本財・サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	61.5	695	81,819	金融
CONCHO RESOURCES INC	14	308	36,294	素材
ENVISION HEALTHCARE CORP	32.5	449	52,852	エネルギー
FIRST DATA CORP- CLASS A	14.36	94	11,123	ヘルスケア
PHILLIPS 66	72	103	12,204	情報技術
MURPHY OIL CORP	106.5	931	109,566	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36	119	14,059	エネルギー
MATTEL INC	108	311	36,663	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VGT SHRS	78	224	26,433	一般消費財・サービス
MYLAN NV	26.5	244	28,815	生活必需品
METLIFE INC	104.5	395	46,489	ヘルスケア
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	213.5	1,160	136,544	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	105	150	17,686	情報技術
MONSANTO CO	33.78	281	33,139	情報技術
	100.56	1,060	124,794	素材

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	253	29,781	ヘルスケア
ROCKWELL AUTOMATION INC	29.5	397	46,814	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	631.71	3,944	463,979	ヘルスケア
MASCO CORP	74	236	27,793	資本財・サービス
M & T BANK CORP	31.69	483	56,843	金融
MARSH & MCLENNAN COS	117.5	804	94,622	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	75.22	647	76,138	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	26.5	182	21,508	情報技術
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	39.5	178	21,006	一般消費財・サービス
VANTIV INC - CL A	35.5	208	24,549	情報技術
NETAPP INC	67	244	28,727	情報技術
NIKE INC -CL B	305.5	1,555	182,985	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	67.5	720	84,696	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	48.5	312	36,814	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	30	214	25,277	金融
ALLY FINANCIAL INC	102	203	23,888	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	39.5	915	107,656	資本財・サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	62	422	49,665	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	120	379	44,689	素材
MCKESSON CORP	51.5	732	86,198	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	64	248	29,232	情報技術
XYLEM INC	42	210	24,751	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	353.5	3,227	379,687	生活必需品
NUCOR CORP	71.5	433	51,009	素材
WESTERN UNION CO	113.46	241	28,360	情報技術
NEWELL BRANDS INC	101.42	468	55,092	一般消費財・サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	175.5	1,288	151,610	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	26	192	22,699	一般消費財・サービス
PAYCHEX INC	75.5	462	54,387	情報技術
PATTERSON COS INC	19	77	9,152	ヘルスケア
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	22	614	72,278	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	443.5	2,973	349,740	生活必需品
P G & E CORP	115	701	82,571	公益事業
PFIZER INC	1,381.63	4,537	533,719	ヘルスケア
ALKERMES PLC	36	203	23,930	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	115	467	55,043	公益事業
STRYKER CORP	78.5	932	109,653	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	30.5	435	51,214	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	37.5	693	81,601	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	14	114	13,438	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	581.67	4,925	579,396	生活必需品
EXELON CORP	213.22	761	89,589	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	51	612	72,013	ヘルスケア
CONOCOPHILLIPS	286.5	1,488	175,042	エネルギー
PEPSICO INC	327	3,461	407,229	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	99	1,047	123,173	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	40.5	295	34,720	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	142	1,746	205,452	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	22	140	16,536	金融
PENTAIR PLC	40.05	226	26,641	資本財・サービス
QUALCOMM INC	336.5	2,236	263,065	情報技術
INVESCO LTD	98.5	309	36,381	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	17	292	34,377	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	66	381	44,873	金融
RAYTHEON COMPANY	67	950	111,771	資本財・サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	18	126	14,884	一般消費財・サービス
RED HAT INC	42	335	39,498	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	18.1	685	80,661	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	56.5	319	37,610	資本財・サービス

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PRICELINE GROUP INC/THE	11.4	1,692	199,039	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	94	653	76,880	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	21	181	21,357	素材
RESMED INC	32.5	203	23,905	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	33	304	35,832	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	28	135	15,977	資本財・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	196.78	1,092	128,559	生活必需品
RITE AID CORP	230	189	22,266	生活必需品
RALPH LAUREN CORP	13	123	14,489	一般消費財・サービス
AUTONATION INC	17	81	9,590	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	29	270	31,796	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	288.35	409	48,164	金融
CHEVRON CORP	433.18	5,114	601,676	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	75	537	63,273	公益事業
TESLA MOTORS INC	26.7	540	63,596	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	147	353	41,638	情報技術
ENDO INTERNATIONAL PLC	46	73	8,673	ヘルスケア
STANLEY BLACK & DECKER INC	34.72	405	47,690	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	34	204	24,040	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	48.85	1,409	165,744	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	71	225	26,525	不動産
TWITTER INC	130	242	28,488	情報技術
NAVIENT CORP	71	116	13,671	金融
SOUTHERN CO/THE	217.5	1,064	125,159	公益事業
SYSCO CORP	124	698	82,207	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	67.23	817	96,164	金融
SOUTHWESTERN ENERGY CO	110	115	13,573	エネルギー
SEI INVESTMENTS COMPANY	32	155	18,263	金融
STERICYCLE INC	19.5	150	17,698	資本財・サービス
SCHLUMBERGER LTD	317.02	2,710	318,838	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	39	156	18,368	資本財・サービス
AT&T INC	1,400.91	5,837	686,675	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	38	189	22,318	資本財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18.3	497	58,499	素材
SEMPRA ENERGY	54	551	64,879	公益事業
TIFFANY & CO	28	223	26,283	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	70	273	32,195	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	230	1,676	192,203	情報技術
SALESFORCE.COM INC	147	1,026	120,799	情報技術
SIGNET JEWELERS LTD	17	159	18,811	一般消費財・サービス
WESTROCK CO	59.3	312	36,774	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	217.84	916	107,827	資本財・サービス
TESORO CORP	28.5	258	30,356	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	189	1,952	229,679	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	190	353	41,548	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	123	616	72,501	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	182.5	1,980	232,965	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	159.5	1,847	217,282	資本財・サービス
UNUM GROUP	54	235	27,663	金融
SPRINT CORP	177.65	146	17,219	電気通信サービス
ANTERO RESOURCES CORP	34	83	9,770	エネルギー
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	34.94	272	32,008	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	50	199	23,437	金融
AMEREN CORPORATION	55	283	33,383	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	217.26	3,561	418,969	ヘルスケア
VERISIGN INC	22	171	20,159	情報技術
VALERO ENERGY CORP	107.92	733	86,323	エネルギー
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	13.9	364	42,859	一般消費財・サービス
FNF GROUP	57.38	197	23,211	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2016年12月19日現在		業種等
		評価	価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ANTHEM INC	20	214	25,191	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	60.5	880	103,518	ヘルスケア
WELLS FARGO & CO	347	3,605	424,135	一般消費財・サービス
FOOT LOCKER INC	1,094.72	6,058	712,623	金融
WASTE MANAGEMENT INC	32	241	28,396	一般消費財・サービス
WILLIAMS COS INC	103	721	84,908	資本財・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	167	514	60,523	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	31	236	27,837	一般消費財・サービス
WAL-MART STORES INC	17	295	34,810	一般消費財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	351.5	2,494	293,480	生活必需品
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	46	476	56,003	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	195	106	12,569	エネルギー
XEROX CORP	18	165	19,458	一般消費財・サービス
WABTEC CORP	192.44	175	20,667	情報技術
TJX COMPANIES INC	21	167	19,648	資本財・サービス
WATERS CORP	149	1,143	134,553	一般消費財・サービス
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	18	246	29,024	ヘルスケア
ALLERGAN PLC	20	148	17,508	資本財・サービス
WHOLE FOODS MARKET INC	90.57	1,746	205,414	ヘルスケア
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	78	251	29,626	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	212.5	1,829	215,168	生活必需品
WESTERN DIGITAL CORP	30.83	377	44,363	金融
WEC ENERGY GROUP INC	64.5	433	50,970	情報技術
WESTAR ENERGY INC	73.8	428	50,359	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	32	183	21,598	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	117.5	516	60,800	公益事業
PPL CORP	429.5	3,365	395,840	情報技術
PULTEGROUP INC	154	533	62,732	公益事業
PPG INDUSTRIES INC	74	139	16,390	一般消費財・サービス
NORTHERN TRUST CORP	61.5	589	69,390	素材
NVIDIA CORP	49	433	50,987	金融
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	124	1,245	146,459	情報技術
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	113.93	1,308	153,930	金融
TYSON FOODS INC-CL A	95.5	192	22,647	一般消費財・サービス
NETFLIX INC	69	430	50,679	生活必需品
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	98	1,217	143,197	一般消費財・サービス
TORCHMARK CORP	90.5	1,289	151,741	ヘルスケア
FIRST REPUBLIC BANK/CA	26.75	196	23,080	金融
TEXTRON INC	34	301	35,506	金融
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	63.5	308	36,301	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	249.5	699	82,264	一般消費財・サービス
OMNICOM GROUP	103	285	33,597	一般消費財・サービス
ORACLE CORP	83.37	96	11,385	一般消費財・サービス
MASTERCARD INC - A	47	158	18,625	公益事業
ONEOK INC	55	473	55,755	一般消費財・サービス
CENTURYLINK INC	702.83	2,748	323,254	情報技術
ROPER TECHNOLOGIES INC	220.5	2,280	268,270	情報技術
YUM! BRANDS INC	49	286	33,672	エネルギー
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	127.95	309	36,377	電気通信サービス
MOLSON COORS BREWING CO-B	23	425	50,051	資本財・サービス
NOBLE ENERGY INC	83	533	62,729	一般消費財・サービス
BANK OF AMERICA CORP	14	320	37,684	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	44	430	50,644	生活必需品
NORDSTROM INC	101	415	48,900	エネルギー
AMERICAN EXPRESS CO	2,325.01	5,268	619,730	金融
ANALOG DEVICES INC	38	324	38,155	ヘルスケア
	30	151	17,813	一般消費財・サービス
	178	1,335	157,036	金融
	70	504	59,359	情報技術

銘柄	株数	2016年12月19日現在		業種等
		評価	価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	60	263	31,004	金融
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	243.22	1,612	189,684	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	14	154	18,131	素材
SKYWORKS SOLUTIONS INC	127	896	105,484	エネルギー
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	44	337	39,754	情報技術
NEWFIELD EXPLORATION CO	40.5	340	40,032	一般消費財・サービス
MALLINCKRODT PLC	45	202	23,862	エネルギー
EVERETT DENNISON CORP	25	134	15,785	ヘルスケア
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21	151	17,770	素材
EMERSON ELECTRIC CO	141.5	796	93,642	情報技術
AON PLC	148.5	827	97,349	資本財・サービス
AMGEN INC	62	694	81,747	金融
CORE LABORATORIES N.V.	171	2,554	300,453	ヘルスケア
COACH INC	10	120	14,149	エネルギー
EATON CORP PLC	64	226	26,590	一般消費財・サービス
CELGENE CORP	104.36	710	83,549	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	179	2,087	245,552	ヘルスケア
APPLIED MATERIALS INC	41.2	650	76,460	生活必需品
CIT GROUP INC	245	796	93,691	情報技術
CIMAREX ENERGY CO	45	194	22,899	金融
CME GROUP INC	22.5	309	36,391	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	78	956	112,542	金融
ECOLAB INC	88.44	342	40,281	エネルギー
EQUIFAX INC	61.5	739	87,006	素材
GAP INC/THE	27.5	321	37,837	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	58	138	16,312	一般消費財・サービス
ST JUDE MEDICAL INC	302	2,237	263,234	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	64.5	510	60,090	ヘルスケア
HORMEL FOODS CORP	43.98	398	46,896	生活必需品
STATE STREET CORP	68.5	237	27,903	生活必需品
STAPLES INC	87.93	691	81,318	金融
SUNTRUST BANKS INC	156	155	18,295	一般消費財・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	115.98	641	75,403	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	274	1,064	125,183	金融
B/E AEROSPACE INC	114	509	59,968	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	23	137	16,143	資本財・サービス
CROWN HOLDINGS INC	46	273	32,211	生活必需品
CARDINAL HEALTH INC	31	163	19,246	素材
FEDEX CORP	71.5	527	62,036	ヘルスケア
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	58.5	1,149	135,204	資本財・サービス
FMC CORP	114.04	1,022	120,288	金融
FLEX LTD	32	183	21,636	素材
CERNER CORP	122	177	20,851	情報技術
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	70	342	40,281	ヘルスケア
CITRIX SYSTEMS INC	18	212	24,986	素材
INTEL CORP	36.5	331	38,937	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1,084	3,936	462,992	情報技術
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	88	210	24,719	一般消費財・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS	91	433	51,006	金融
SIRIUS XM HOLDINGS INC	74	924	108,738	資本財・サービス
ILLUMINA INC	385	174	20,469	一般消費財・サービス
SEALED AIR CORP	33.5	438	51,625	ヘルスケア
INTUITIVE SURGICAL INC	44	207	24,434	素材
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8.7	558	65,638	ヘルスケア
SNAP-ON INC	31	263	30,991	情報技術
CALPINE CORP	13	223	26,299	資本財・サービス
CARMAX INC	72	83	9,790	公益事業
COMERICA INC	46	285	33,629	一般消費財・サービス
	40	270	31,840	金融

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	評 価 額	業 種 等	
	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
INGREDION INC	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DUKE ENERGY CORP	158.28	1,212	23,680	生活必需品
TARGET CORP	124	951	142,598	公益事業
DOVER CORP	35	264	111,948	一般消費財・サービス
WW GRAINGER INC	13	305	31,116	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	29	170	35,879	資本財・サービス
CINTAS CORP	18.5	221	20,054	資本財・サービス
CA INC	71.05	227	26,046	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	95	364	26,761	生活必需品
CLOROX COMPANY	29.5	351	42,922	生活必需品
ENTERGY CORP	42.5	310	41,307	公益事業
MICROSOFT CORP	1,693.5	10,550	36,579	情報技術
INCYTE CORP	38.5	396	1,241,055	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	242.74	1,931	46,646	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	316.38	2,324	227,171	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	241	488	273,387	ヘルスケア
BLACKROCK INC	27.5	1,079	57,463	情報技術
CENTERPOINT ENERGY INC	91	221	127,005	金融
HASBRO INC	26	210	26,000	公益事業
KELLOGG CO	61	447	24,733	一般消費財・サービス
KEYCORP	245	444	52,588	生活必需品
KANSAS CITY SOUTHERN	24	207	52,335	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	356.11	1,580	24,451	資本財・サービス
KOHL'S CORP	44	225	185,862	生活必需品
COOPER COS INC/THE	11	192	26,468	一般消費財・サービス
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	111	190	22,670	ヘルスケア
APACHE CORP	87.6	581	22,431	金融
CHUBB LTD	105.99	1,406	68,410	エネルギー
ARROW ELECTRONICS INC	20	143	165,457	金融
ALLSTATE CORP	87	644	16,886	情報技術
EBAY INC	250	740	75,842	金融
PAYPAL HOLDINGS INC	249.5	981	87,075	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	35	266	115,399	情報技術
XILINX INC	59.5	347	31,301	素材
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	143.1	1,000	40,916	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	53	309	117,695	ヘルスケア
YAHOO! INC	210	810	36,408	一般消費財・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	51.5	392	95,375	情報技術
TOLL BROTHERS INC	38	120	46,119	生活必需品
TRIMBLE INC	59	180	14,120	一般消費財・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	56	347	21,229	情報技術
LENNAR CORP-A	44	191	40,920	情報技術
LEAR CORP	17	229	22,472	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	65	224	26,946	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	134	478	26,424	金融
PRAXAIR INC	66	808	56,303	金融
PACCAR INC	79.87	519	95,096	素材
PVH CORP	19	174	21,162	資本財・サービス
BIOGEN INC	49.8	1,426	20,557	一般消費財・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	20	238	167,772	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	336	1,937	28,097	ヘルスケア
PERRIGO CO PLC	34	281	227,893	一般消費財・サービス
EVERSOURCE ENERGY	74.8	408	33,147	ヘルスケア
INTUIT INC	56	656	48,014	公益事業
BORGWARNER INC	48	190	77,275	情報技術
BEST BUY CO INC	65	305	22,438	一般消費財・サービス
BALL CORP	37.92	290	35,935	一般消費財・サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	310.47	664	34,194	素材
BED BATH & BEYOND INC	36	170	78,154	ヘルスケア
			20,017	一般消費財・サービス

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	評 価 額	業 種 等	
	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
XL GROUP LTD	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ELECTRONIC ARTS INC	68	247	29,123	金融
VULCAN MATERIALS CO	70.5	560	65,936	情報技術
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	30.5	376	44,290	素材
VF CORP	56.5	433	51,042	ヘルスケア
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	77.5	416	49,027	一般消費財・サービス
VIACOM INC-CLASS B	94.71	611	71,902	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	81.71	287	33,851	一般消費財・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	15	295	34,759	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	52	78	9,260	情報技術
CARNIVAL CORP	22	200	23,565	ヘルスケア
COMCAST CORP-CLASS A	80.5	414	48,766	一般消費財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	545.7	3,812	448,436	一般消費財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	58	319	37,558	資本財・サービス
	265	163	19,201	不動産
アメリカ・ドル 株数・金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	70,945.95	454,941	53,514,809	
	591銘柄		<63.4%>	
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	72	347	30,611	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4.4	265	23,442	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	46.96	148	13,074	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	53.87	348	30,766	一般消費財・サービス
SILVER WHEATON CORP	107	248	21,892	素材
INTACT FINANCIAL CORP	31.5	295	26,099	金融
BCE INC	33.3	196	17,326	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	43	323	28,520	素材
SUNCOR ENERGY INC	386.3	1,691	149,182	エネルギー
METRO INC	55	221	19,547	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	77	427	37,721	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	282	2,144	189,108	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	91.5	1,014	89,473	金融
TORONTO-DOMINION BANK	432	2,870	253,123	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	67	239	21,123	金融
ROYAL BANK OF CANADA	348.5	3,193	281,617	金融
TOURMALINE OIL CORP	47	166	14,652	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	25	144	12,705	エネルギー
TRANSNASCANADA CORP	189.5	1,167	102,945	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	94	396	34,991	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	454	93	8,207	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	273	517	45,623	素材
CAE INC	58	109	9,626	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	78.04	461	40,722	金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	202	486	42,897	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	39	58	5,159	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	14	67	5,981	素材
VERESEN INC	80	98	8,663	エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6.9	158	13,962	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	97	122	10,795	金融
LINAMAR CORP	11	65	5,769	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	54	163	14,458	エネルギー
HYDRO ONE LTD	40	94	8,303	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	51.6	363	32,090	生活必需品
EMERA INC	13	58	5,179	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	28	102	9,059	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	86	437	38,581	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	51	253	22,353	素材
KINROSS GOLD CORP	295	120	10,588	素材
BANK OF MONTREAL	152	1,472	129,893	金融
POWER CORP OF CANADA	87	263	23,270	金融
METHANEX CORP	22	134	11,887	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2016年12月19日現在		業種等
		評価	価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
CAMECO CORP	92	133	11,756	エネルギー
TELUS CORP	54	230	20,311	電気通信サービス
POWER FINANCIAL CORP	56	191	16,865	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	134	365	32,214	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	17	240	21,178	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	208	92	8,126	素材
AGRIUM INC	31	413	36,437	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	255	1,139	100,523	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HDGS LTD	5.4	331	29,261	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	93	555	49,021	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	11	124	10,988	生活必需品
BLACKBERRY LTD	119	120	10,610	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	142.5	734	64,783	金融
ENBRIDGE INC	220	1,261	111,269	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	205.5	917	80,883	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	458	1,124	99,200	金融
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	71	133	11,802	ヘルスケア
GOLDCORP INC	199.59	332	29,289	素材
ENCANA CORP	232	378	33,390	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	33	639	56,380	資本財・サービス
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	22	119	10,539	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	52	193	17,027	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	180.5	1,615	142,484	資本財・サービス
CGI GROUP INC - CLASS A	53	333	29,446	情報技術
HUSKY ENERGY INC	75.58	126	11,151	エネルギー
ONEX CORPORATION	20	182	16,073	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	95	256	22,629	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	39	103	9,104	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	34	192	16,950	資本財・サービス
ELDORADO GOLD CORP	172	64	5,657	素材
IGM FINANCIAL INC	23	91	8,036	金融
OPEN TEXT CORP	28	225	19,927	情報技術
CI FINANCIAL CORP	54	156	13,767	金融
SAPUTO INC	58	269	23,779	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	171	244	21,534	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	98	615	54,249	生活必需品
YAMANA GOLD INC	233	82	7,294	素材
FORTIS INC	96	389	34,322	公益事業
CRESCENT POINT ENERGY CORP	133	244	21,570	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	196	415	36,644	エネルギー
DOLLARAMA INC	27	270	23,847	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	17	76	6,721	公益事業
ALTAGAS LTD	39	133	11,759	エネルギー
FIRST CAPITAL REALTY INC	26	53	4,693	不動産
KEYERA CORP	40	161	14,202	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	39	132	11,652	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	81	241	21,280	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	83	200	17,677	エネルギー
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	9,502.44 90銘柄	38,205 3,369,325 < 4.0%>	
(オーストラリア)	百株	千円		
HEALTHSCOPE LTD	375	85	7,372	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD	617	170	14,619	金融
BHP BILLITON LIMITED	752	1,880	161,398	素材
SOUTH32 LTD	1,272	331	28,501	素材
LENDELEASE GROUP	121	170	14,615	不動産
ALUMINA LTD	569	99	8,499	素材

銘柄	株数	2016年12月19日現在		業種等
		評価	価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	182	562	48,327	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	397	250	21,471	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	118	144	12,409	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	620	1,858	159,521	金融
WESTPAC BANKING CORP	780.98	2,513	215,824	金融
SANTOS LTD	340	134	11,558	エネルギー
AUSNET SERVICES	410	61	5,297	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	689	2,053	176,328	金融
RIO TINTO LTD	97	575	49,373	素材
ORIGIN ENERGY LTD	414	267	22,995	エネルギー
AMCOR LIMITED	267	391	33,580	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	468	229	19,687	資本財・サービス
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	100	37	3,253	電気通信サービス
OIL SEARCH LTD	329	226	19,432	エネルギー
SEEK LTD	75	111	9,548	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	171	177	15,252	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	176	294	25,308	素材
INCITEC PIVOT LTD	456	163	14,014	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	401	3,250	279,055	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	60	177	15,221	エネルギー
ORICA LTD	83	140	12,020	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	328	407	34,973	金融
CIMIC GROUP LTD	29	97	8,382	資本財・サービス
WOOLWORTHS LTD	300	688	59,107	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	137	134	11,514	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	205	96	8,271	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	106	121	10,456	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	145.54	48	4,148	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	986	484	41,562	電気通信サービス
AMP LTD	665	329	28,259	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	103	218	18,719	素材
MACQUARIE GROUP LTD	72.84	637	54,741	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	126	190	16,312	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	91	104	8,984	金融
CSL LTD	106	1,027	88,207	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	267.45	1,108	95,171	生活必需品
COCHLEAR LTD	14	162	13,945	ヘルスケア
SUNCORP GROUP LTD	312	412	35,383	金融
BORAL LTD	227	119	10,270	素材
ASX LTD	42	203	17,473	金融
COMPUTERSHARE LTD	104	128	10,990	情報技術
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	69	5,973	一般消費財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	549	320	27,477	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	95	205	17,608	ヘルスケア
TRANSURBAN GROUP	478	488	41,980	資本財・サービス
CHALLENGER LTD	122	135	11,657	金融
SYDNEY AIRPORT	251	161	13,834	資本財・サービス
TATTS GROUP LTD	369	163	14,033	一般消費財・サービス
AGL ENERGY LTD	152	318	27,338	公益事業
BRAMBLES LTD	373	448	38,490	資本財・サービス
APA GROUP	267	220	18,910	公益事業
DUET GROUP	500	140	12,019	公益事業
RAMSAY HEALTH CARE LTD	33	220	18,967	ヘルスケア
TPG TELECOM LTD	65	43	3,749	電気通信サービス
REA GROUP LTD	12	64	5,496	一般消費財・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	14	87	7,537	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	18,126.81 62銘柄	26,167 2,246,440 < 2.7%>	

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	330	2,277	34,496	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	550	1,864	28,247	一般消費財・サービス
MTR CORP	345	1,307	19,809	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	350	3,480	52,733	不動産
SINO LAND CO	880	1,008	15,278	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	631.69	5,685	86,130	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	320	1,672	25,330	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	125	921	13,956	不動産
CLP HOLDINGS LTD	425	3,087	46,777	公益事業
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	330	335	5,089	資本財・サービス
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	283.86	1,168	17,696	不動産
HANG LUNG GROUP LTD	210	611	9,258	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,811.42	2,499	37,871	公益事業
HANG SENG BANK LTD	179	2,631	39,864	金融
WHEELLOCK & CO LTD	250	1,103	16,721	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,290	1,070	16,221	不動産
WH GROUP LTD	1,350	876	13,273	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	273	5,053	76,556	金融
LI & FUNG LTD	1,320	469	7,119	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	520	876	13,282	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	65	499	7,567	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	210	609	9,226	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	465	593	8,989	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	180	386	5,849	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	290.4	888	13,462	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	140	461	6,988	不動産
SJM HOLDINGS LTD	470	282	4,286	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	300	652	9,885	不動産
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	641.69	3,230	48,948	不動産
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	150	934	14,157	公益事業
PCCW LTD	950	406	6,159	電気通信サービス
AIA GROUP LTD	2,830	12,565	190,362	金融
SANDS CHINA LTD	572	1,887	28,597	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	300	247	3,754	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	315	894	13,553	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	200	296	4,496	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	875	2,423	36,719	金融
WYNN MACAU LTD	380	470	7,127	一般消費財・サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	570	538	8,160	電気通信サービス
香 港 ド ル 株数・金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	21,678.06 39銘柄	66,271	1,004,008 < 1.2%>	
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	300	627	51,155	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	415	748	60,959	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	124.7	122	9,945	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	345	207	16,864	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	132	82	6,742	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	112	91	7,463	不動産
CAPITALAND LTD	590	178	14,516	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	410	147	12,024	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30	119	9,744	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	742	681	55,493	金融
GENTING SINGAPORE PLC	1,530	144	11,779	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,886.5	703	57,327	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	350	116	9,523	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	290	84	6,875	資本財・サービス
GOLDEN AGRICULTURE RESOURCES LTD	2,194	93	7,596	生活必需品

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千シンガポール・ドル	千円	
SATS LTD	160	79	6,478	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	190	139	11,330	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	468	121	9,913	資本財・サービス
STARHUB LTD	160	44	3,662	電気通信サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	560	207	16,880	生活必需品
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	690	153	12,535	不動産
シンガポール・ドル 株数・金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	11,679.2 21銘柄	4,895	398,815 < 0.5%>	
(ニュージーランド)	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	260	65	5,377	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	526.89	179	14,702	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	234	148	12,194	資本財・サービス
CONTACT ENERGY LTD	130	61	5,014	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	201	207	17,023	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	53	42	3,523	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル 株数・金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	1,404.89 6銘柄	704	57,835 < 0.1%>	
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT	163	71	10,498	一般消費財・サービス
TUI AG-DI	117.47	130	19,138	一般消費財・サービス
BP PLC	4,363	2,136	313,882	エネルギー
UNILEVER PLC	301.1	949	139,427	生活必需品
BARCLAYS PLC	3,975	906	133,232	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	434	292	43,037	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	381	135	19,875	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	23	128	18,837	素材
PRUDENTIAL PLC	602	952	140,000	金融
INMARSAT PLC	103	76	11,174	電気通信サービス
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	792.91	180	26,512	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	45.64	140	20,590	素材
BAE SYSTEMS PLC	731	433	63,629	資本財・サービス
AVIVA PLC	939.66	449	66,068	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,130.02	1,724	253,333	ヘルスケア
WORLDPAY GROUP PLC	427	114	16,824	情報技術
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	80	58	8,520	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	252	97	14,393	情報技術
DCC PLC	20	117	17,217	資本財・サービス
ROYAL MAIL PLC	224	101	14,874	資本財・サービス
RELX PLC	256.46	356	52,408	資本財・サービス
DIAGEO PLC	585	1,202	176,611	生活必需品
RIO TINTO PLC	291.5	901	132,391	素材
STANDARD CHARTERED PLC	758	519	76,280	金融
TESCO PLC	1,911	382	56,261	生活必需品
FRESNILLO PLC	50	55	8,087	素材
SMITH & NEPHEW PLC	215	254	37,365	ヘルスケア
GLENCORE PLC	2,839.25	762	111,953	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	57	70	10,350	金融
SMITHS GROUP PLC	93.33	131	19,332	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	61	57	8,491	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	339.83	121	17,793	金融
DIXONS CARPHONE PLC	248	85	12,536	一般消費財・サービス
PEARSON PLC	188.63	154	22,765	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	381.25	95	14,002	生活必需品
NEXT PLC	33	163	23,997	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	739	113	16,610	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	43.11	156	22,945	一般消費財・サービス
IMI PLC	58.5	59	8,671	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	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	評 価 額	業 種 等	
	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
BUNZL PLC	77.55	160	23,594	資本財・サービス
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	206	52	7,695	金融
GKN PLC	406	133	19,671	一般消費財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	6,261.83	1,255	184,399	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	29.93	95	14,035	素材
KINGFISHER PLC	519.11	178	26,150	一般消費財・サービス
WPP PLC	298	530	77,970	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	159.27	140	20,590	公益事業
SEVERN TRENT PLC	57.33	125	18,385	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	149	985	144,777	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	119	118	17,464	金融
SCHRODERS PLC	32	95	14,032	金融
TATE & LYLE PLC	101	69	10,149	生活必需品
SSE PLC	238	361	53,041	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	48	89	13,123	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	227	103	15,240	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	293	1,289	189,439	ヘルスケア
WOLSELEY PLC	59.65	290	42,746	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,381	335	49,239	金融
3I GROUP PLC	229.91	156	22,967	金融
SKY PLC	248	245	36,105	一般消費財・サービス
ASHTAD GROUP PLC	122	196	28,873	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	261.14	169	24,898	情報技術
NATIONAL GRID PLC	888.28	826	121,492	公益事業
LYDDY BANKING GROUP PLC	15,039.65	959	140,920	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	242.6	138	20,297	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	226.5	790	116,130	生活必需品
CENTRICA PLC	1,283.6	295	43,390	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	30	83	12,322	一般消費財・サービス
PROVIDENT FINANCIAL PLC	36.5	100	14,746	金融
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	435.6	1,963	288,388	生活必需品
NEX GROUP PLC	120	58	8,550	その他
BHP BILLITON PLC	487.77	636	93,514	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	85	228	33,541	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	4,633	3,089	453,914	金融
SHIRE PLC	210.74	968	142,322	ヘルスケア
OLD MUTUAL PLC	1,170.25	233	34,246	金融
ANGLO AMERICAN PLC	334.83	379	55,732	素材
MONDI PLC	83	129	19,021	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	509	115	16,959	生活必需品
CARNIVAL PLC	45.11	183	26,959	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	35	36	5,362	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	388.41	549	80,741	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	75.5	128	18,922	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	1,956	717	105,459	電気通信サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	44	72	10,723	生活必需品
WILLIAM HILL PLC	192	57	8,414	一般消費財・サービス
BURBERRY GROUP PLC	104.89	156	22,944	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	44.77	156	23,039	一般消費財・サービス
CAPITA PLC	150.9	73	10,864	資本財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC	59	85	12,550	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	38	126	18,606	資本財・サービス
ITV PLC	868	170	24,980	一般消費財・サービス
PETROFAC LTD	56	48	7,178	エネルギー
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	75.49	211	31,074	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,000	2,175	319,529	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	868.18	1,987	291,948	エネルギー
MEGGITT PLC	177	84	12,411	資本財・サービス
G4S PLC	346	81	11,950	資本財・サービス
COBHAM PLC	386	67	9,901	資本財・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	33	59	8,687	ヘルスケア

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	評 価 額	業 種 等	
	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
ADMIRAL GROUP PLC	52	92	13,613	金融
INVESTEC PLC	145	77	11,375	金融
ANTOFAGASTA PLC	86	57	8,464	素材
STANDARD LIFE PLC	454.63	166	24,418	金融
EXPERIAN PLC	230.54	348	51,209	資本財・サービス
イギリス・ポンド 通 貨 計	株数、金額 105銘柄 < 7.1% >	69,505.12	40,986	6,021,345
(イスラエル)	株数、金額 8銘柄 < 0.1% >	1,384	2,737	83,096
AZRIELI GROUP LTD	10	166	5,039	不動産
FRUTAROM	9	182	5,527	素材
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	564	384	11,669	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD	140	214	6,524	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	6	235	7,142	資本財・サービス
BANK HAPOLIM BM	265	593	18,013	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	376	592	17,979	金融
NICE LTD	14	368	11,199	情報技術
イスラエル・シェケル 通 貨 計	株数、金額 8銘柄 < 0.1% >	1,384	2,737	83,096
(スイス)	株数、金額 38銘柄 < 3.4% >	3,792.09	25,073	2,873,473
DUFREY AG-REG	10.5	131	15,113	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	860	1,425	163,405	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	101	11,677	素材
ADECCO GROUP AG-REG	40	266	30,575	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	163.5	3,817	437,511	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	8	52	6,037	金融
SIKA AG-BR	0.5	239	27,492	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	120	13,795	生活必需品
ABB LTD-REG	439	947	108,567	資本財・サービス
ARYZTA AG	21	93	10,757	生活必需品
SWISS RE AG	75.5	730	83,754	金融
NESTLE SA-REG	727	5,248	601,528	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	4.2	201	23,055	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	175	20,100	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	435.2	684	78,451	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	52	240	27,561	金融
SGS SA-REG	1.3	267	30,615	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	5	87	9,998	資本財・サービス
GALENICA AG-REG	0.9	101	11,675	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7.5	231	26,506	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	35.12	983	112,733	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	12	155	17,822	金融
NOVARTIS AG-REG	522	3,847	440,882	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.5	60	6,939	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	120	802	91,932	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	5.9	263	30,243	電気通信サービス
GEBERT AG-REG	9	360	41,266	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	2.2	403	46,188	素材
ACTELION LTD-REG	22.5	490	56,262	ヘルスケア
SYNGENTA AG-REG	21.62	893	102,376	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	13	156	17,922	ヘルスケア
LONZA GROUP AG-REG	13	220	25,252	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	11	66	7,645	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	104.4	554	63,530	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	8	231	26,523	金融
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	12.5	168	19,353	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	16	129	14,842	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.23	118	13,574	生活必需品
スイス・フラン 通 貨 計	株数、金額 38銘柄 < 3.4% >	3,792.09	25,073	2,873,473

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)	百株	千円	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	445	11,360	188,022	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	163.5	3,505	58,015	金融
ISS A/S	39	941	15,587	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.95	1,039	17,200	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52	2,249	37,220	資本財・サービス
TDC A/S	193	683	11,313	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B	24.5	1,468	24,308	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	55	1,335	22,100	素材
COLOPLAST-B	28	1,316	21,779	ヘルスケア
DSV A/S	46	1,430	23,676	資本財・サービス
WILLIAM DEMANT HOLDING	33.75	420	6,954	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1.5	1,728	28,598	資本財・サービス
PANDORA A/S	26.5	2,279	37,717	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	23.5	909	15,047	素材
GENMAB A/S	13	1,480	24,505	ヘルスケア
DONG ENERGY A/S	20	492	8,142	公益事業
デンマーク・クロネ 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,165.2 16銘柄	32,639 540,190 < 0.6%>	
(ノルウェー)	百株	千円	千円	
NORSK HYDRO ASA	306	1,270	17,257	素材
DNB ASA	225.5	2,958	40,177	金融
ORKLA ASA	190.5	1,457	19,790	生活必需品
TELENOR ASA	178	2,314	31,424	電気通信サービス
STATOIL ASA	261.73	4,135	56,157	エネルギー
SCHIBSTED ASA-CL A	15	281	3,819	一般消費財・サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	41.6	1,360	18,473	素材
MARINE HARVEST	87	1,331	18,076	生活必需品
GJENSIDIGE FORSKRING ASA	48.5	646	8,772	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	18	315	4,289	一般消費財・サービス
ノルウェー・クロネ 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,371.83 10銘柄	16,070 218,239 < 0.3%>	
(スウェーデン)	百株	千円	千円	
ICA GRUPPEN AB	19	515	6,482	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	722.3	4,034	50,748	情報技術
VOLVO AB-B SHS	345	3,743	47,090	資本財・サービス
MILICOM INTL CELLULAR-SDR	15	585	7,359	電気通信サービス
SKF AB-B SHARES	86.5	1,470	18,498	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	54.5	1,236	15,556	一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB	706.5	7,312	91,988	金融
SWEDISH MATCH AB	45.5	1,355	17,057	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	89.5	647	8,151	電気通信サービス
GETINGE AB-B SHS	47	694	8,738	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	341.5	3,377	42,488	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	352	4,618	58,097	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	213	4,835	60,825	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	217	5,605	70,512	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	141	3,588	45,142	生活必需品
SKANSKA AB-B SHS	82.5	1,796	22,593	資本財・サービス
SANDVIK AB	244.5	2,841	35,740	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	108	3,695	46,492	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	157	4,493	56,526	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	92	1,271	15,994	資本財・サービス
TELIA CO AB	600	2,205	27,738	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB	70	1,043	13,129	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	91	2,332	29,340	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	233	4,000	50,327	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	9	493	6,210	金融

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
LUNDIN PETROLEUM AB	50	970	12,202	エネルギー
BOLIDEN AB	60	1,509	18,990	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	97.5	676	8,506	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B	53	1,205	15,168	金融
HEXAGON AB-B SHS	62	2,040	25,668	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	35	593	7,463	金融
スウェーデン・クロネ 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,439.8 31銘柄	74,787 940,832 < 1.1%>	
(ユーロ (アイルランド))	百株	千ユーロ	千円	
BANK OF IRELAND	6,618	161	19,863	金融
KERRY GROUP PLC-A	38.5	252	31,072	生活必需品
CRH PLC	194	623	76,698	素材
PADDY POWER BETFAIR PLC	19	194	23,956	一般消費財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,869.5 4銘柄	1,232 151,590 < 0.2%>	
(ユーロ (オランダ))	百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N.V.	54.5	145	17,866	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	218.76	612	75,320	資本財・サービス
NN GROUP NV	76	240	29,644	金融
UNILEVER NV-CVA	378.5	1,448	178,159	生活必需品
HEINEKEN NV	53	374	46,060	生活必需品
RELX NV	234.19	368	45,343	資本財・サービス
AEGON NV	407.44	214	26,432	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	298.83	584	71,900	生活必需品
AKZO NOBEL	58	344	42,422	素材
KONINKLIJKE DSM NV	44	248	30,607	素材
WOLTERS KLUWER	69	232	28,633	資本財・サービス
BOSKALIS WESTMINSTER	21	68	8,410	資本財・サービス
ING GROEP NV	902.5	1,227	150,982	金融
KONINKLIJKE KPN NV	782.5	215	26,527	電気通信サービス
ASML HOLDING NV	86.8	885	108,908	情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA	54	114	14,035	金融
VOPAK	16	69	8,600	エネルギー
RANDSTAD HOLDING NV	30	156	19,219	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	23	152	18,706	生活必需品
GEMALTO	20	109	13,506	情報技術
ALTICE NV - A	89	168	20,680	一般消費財・サービス
ALTICE NV - B	29	54	6,731	一般消費財・サービス
AIRBUS GROUP SE	136	872	107,369	資本財・サービス
EXOR NV	25	103	12,706	金融
CNH INDUSTRIAL NV	243	201	24,809	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	193.5	164	20,220	一般消費財・サービス
FERRARI NV	28.35	158	19,546	一般消費財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,571.87 27銘柄	9,538 1,173,353 < 1.4%>	
(ユーロ (ベルギー))	百株	千ユーロ	千円	
UCB SA	27.5	160	19,799	ヘルスケア
KBC GROEP NV	58	353	43,449	金融
COLRUYT SA	16	73	9,067	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	17	135	16,608	金融
SOLVAY SA	17	190	23,379	素材
UMICORE	22.5	119	14,715	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	179	1,769	217,721	生活必需品
AGEAS	47.9	179	22,066	金融
PROXIMUS	35	93	11,551	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	12	61	7,540	一般消費財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	431.9 10銘柄	3,137 385,898 < 0.5%>	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	外貨建金額	評価価額 邦貨換算金額	
ユーロ (ルクセンブルグ)	百株	千ユーロ	千円	
RTL GROUP	10	67	8,253	一般消費財・サービス
ARCELOMITTAL	423	315	38,801	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	2.7	110	13,557	ヘルスケア
SES	83.5	170	20,958	一般消費財・サービス
TENARIS SA	105.5	172	21,166	エネルギー
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	624.7 5銘柄	835 102,737 < 0.1%>	
ユーロ (フランス)	百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA	16	43	5,338	一般消費財・サービス
SFR GROUP SA	23	60	7,384	電気通信サービス
TOTAL SA	521.5	2,514	309,265	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	42	441	54,299	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	90.48	959	118,033	素材
KERING	18	381	46,918	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	132	867	106,711	資本財・サービス
BOUYGUES SA	46.5	157	19,362	資本財・サービス
BNP PARIBAS	245	1,493	183,717	金融
PEUGEOT SA	112.5	176	21,719	一般消費財・サービス
NATIXIS	229.5	123	15,145	金融
THALES SA	25.5	234	28,820	資本財・サービス
DANONE	138	845	103,957	生活必需品
CARREFOUR SA	129	293	36,132	生活必需品
SUEZ	74.75	98	12,169	公益事業
VIVENDI	237.41	431	53,092	一般消費財・サービス
L'OREAL	58.5	989	121,685	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	115	499	61,429	資本財・サービス
LEGRAND SA	63.67	338	41,666	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	13	58	7,208	生活必需品
PERNOD RICARD SA	49.17	504	62,026	生活必需品
SOCIETE BIC SA	7	88	10,832	資本財・サービス
EURAZEO	10.75	58	7,187	金融
REXEL SA	70.5	108	13,389	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA	180	845	103,966	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	65.5	1,173	144,384	一般消費財・サービス
ACCOR SA	40	147	18,190	一般消費財・サービス
CAPGEMINI	39	306	37,712	情報技術
VALEO SA	56.5	313	38,586	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	46	295	36,344	一般消費財・サービス
BUREAU VERITAS SA	60.5	110	13,544	資本財・サービス
EIFFAGE	13	85	10,467	資本財・サービス
SODEXO	21.5	228	28,047	一般消費財・サービス
INGENICO GROUP	12	88	10,874	情報技術
ZODIAC AEROSPACE	48	108	13,332	資本財・サービス
SEB SA	6	75	9,347	一般消費財・サービス
ESSILOR INTERNATIONAL	49	515	63,439	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA	0.6	64	7,982	資本財・サービス
AXA SA	455	1,091	134,270	金融
CHRISTIAN DIOR SE	13	257	31,726	一般消費財・サービス
LAGARDERE SCA	26.5	68	8,380	一般消費財・サービス
TECHNIP SA	25.5	169	20,884	エネルギー
EDENRED	47.5	89	11,008	資本財・サービス
RENAULT SA	44	375	46,141	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	6.2	240	29,537	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	5.5	44	5,438	生活必需品
ATOS SE	21.5	210	25,891	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA	30.5	214	26,431	情報技術
WENDEL	6	68	8,384	金融
ORANGE	469	656	80,768	電気通信サービス
ALSTOM	36.5	94	11,637	資本財・サービス

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	外貨建金額	評価価額 邦貨換算金額	
ユーロ (ドイツ)	百株	千ユーロ	千円	
CNP ASSURANCES	37.5	66	8,125	金融
SANOFI	270.75	2,014	247,755	ヘルスケア
VINCI SA	118.5	761	93,684	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	105.5	164	20,251	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	257	305	37,620	金融
ENGIE	341.73	414	50,968	公益事業
IMERYS SA	9	64	7,910	素材
EDF	55.5	53	6,629	公益事業
SAFRAN SA	74	507	62,453	資本財・サービス
ILIAD SA	6	106	13,096	電気通信サービス
ARKEMA	15.5	145	17,882	素材
ADP	7.5	73	9,084	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	40.5	75	9,253	一般消費財・サービス
SCOR SE	41	131	16,176	金融
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	104.5	93	11,497	資本財・サービス
BOLLORE	190	63	7,766	資本財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,967.51 67銘柄	24,749 3,044,376 < 3.6%>	
ユーロ (スイス)	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	192.5	1,878	231,040	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	38	108	13,314	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	321.5	589	72,471	金融
COMMERZBANK AG	246.85	190	23,466	金融
VOLKSWAGEN AG	8	111	13,742	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	43.5	570	70,204	一般消費財・サービス
MAN SE	8.5	80	9,870	資本財・サービス
SIEMENS AG-REG	179	2,067	254,317	資本財・サービス
E.ON SE	465	303	37,294	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	77.5	697	85,799	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	42	157	19,384	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG	21.6	103	12,699	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	25.5	468	57,622	一般消費財・サービス
BASF SE	213.5	1,872	230,375	素材
LINDE AG	44	716	88,087	素材
K+S AG-REG	44	95	11,788	素材
ALLIANZ SE-REG	106.8	1,673	205,798	金融
THYSENKRUPP AG	85	197	24,325	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	42	469	57,708	生活必需品
RWWE AG	118	133	16,423	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50.5	65	8,029	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	9	50	6,255	資本財・サービス
BRENINTAG AG	36.5	191	23,567	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	97	699	85,993	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	27	98	12,069	情報技術
HOCHTIEF AG	5	66	8,226	資本財・サービス
SAP SE	228.42	1,860	228,801	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	37.2	657	80,903	金融
SCHAEFFLER AG	38	51	6,385	一般消費財・サービス
ZALANDO SE	19	67	8,346	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	33	288	35,433	素材
COVESTRO AG	16	102	12,655	素材
INNOGY SE	34	105	12,990	公益事業
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PREF	37	190	23,444	一般消費財・サービス
BEIERSDORF AG	23	182	22,427	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF	15	59	7,289	素材
MERCK KGAA	31	303	37,301	ヘルスケア
ADIDAS AG	44.2	639	78,701	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	24	235	29,020	生活必需品
METRO AG	41	127	15,695	生活必需品

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	百株 754	千ユーロ 1,206	千円 148,399	電気通信サービス
FRESNIUS MEDICAL CARE AG &	50.5	398	49,025	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	225	1,588	195,456	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	270	442	54,385	情報技術
HANNOVER RUECK SE	14	144	17,738	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	225	700	86,131	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	46	366	45,058	金融
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	50.5	183	22,568	一般消費財・サービス
LANXESS AG	22	137	16,865	素材
AXEL SPRINGER SE	10	44	5,501	一般消費財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	82	232	28,611	不動産
SYMRISE AG	30	169	20,853	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	165	66	8,181	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PF	12	88	10,914	一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD	16.5	94	11,569	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	109	323	39,842	不動産
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,250.07 56銘柄	3,040,371 < 3.6%>	-----
ユーロ (ポルトガル)	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	60	88	10,893	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	495	141	17,377	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	103.5	146	17,976	エネルギー
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	658.5 3銘柄	46,248 < 0.1%>	-----
ユーロ (スペイン)	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA	1,046.27	917	112,819	電気通信サービス
ENDESA SA	76.5	154	18,980	公益事業
BANCO POPULAR ESPANOL	754.73	76	9,376	金融
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,534.12	1,005	123,644	金融
IBERDROLA SA	1,271.34	762	93,848	公益事業
BANCO DE SABADELL SA	1,319.09	184	22,684	金融
BANKINTER SA	151	114	14,138	金融
REPSOL SA	257	355	43,705	エネルギー
GRIFOLS SA	67	121	14,979	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	3,438.5	1,730	212,880	金融
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	149	198	24,404	資本財・サービス
AMADEUS IT GROUP SA	100	428	52,728	情報技術
GAS NATURAL SDG SA	84.5	147	18,169	公益事業
MAPFRE SA	214.5	65	8,079	金融
CAIXABANK S.A	748	241	29,747	金融
ZARDOYA OTIS SA	45.5	36	4,511	資本財・サービス
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	180	98	12,153	資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	44.76	135	16,660	資本財・サービス
AENA SA	16	212	26,097	資本財・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	253	820	100,989	一般消費財・サービス
ENAGAS SA	54	132	16,340	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	100	174	21,434	公益事業
FERROVIAL SA	117	200	24,718	資本財・サービス
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	157	71	8,831	生活必需品
BANKIA SA	1,084.22	108	13,403	金融
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	13,263.03 25銘柄	1,045,328 < 1.2%>	-----
ユーロ (イタリア)	百株	千ユーロ	千円	
UNIPOLSAI SPA	217.5	44	5,474	金融
PRYSMIAN SPA	48	116	14,282	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	278.43	400	49,319	金融
SAIPEM SPA	1,343	65	8,078	エネルギー
MEDIOBANCA SPA	130.15	101	12,431	金融
UNICREDIT SPA	1,235.69	354	43,655	金融

銘柄	2016年12月19日現在			業 種 等
	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
TELECOM ITALIA SPA	百株 2,362.82	千ユーロ 190	千円 23,455	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP	1,349.5	89	10,964	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO-RSP	210	46	5,708	金融
INTESA SANPAOLO	2,985.97	720	88,667	金融
ATLANTIA SPA	99.07	219	26,944	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	118	74	9,224	金融
ENI SPA	598	899	110,707	エネルギー
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	95.25	127	15,700	資本財・サービス
ENEL SPA	1,778.34	715	87,982	公益事業
SNAM SPA	582	219	26,975	エネルギー
LUXOTTICA GROUP SPA	37	188	23,234	一般消費財・サービス
TERNA SPA	354	149	18,428	公益事業
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	13,822.72 18銘柄	4,725 < 0.7%>	-----
ユーロ (フィンランド)	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	124	275	33,938	素材
NOKIA OYJ	1,358.5	632	77,772	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	32	133	16,481	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	131	128	15,816	素材
METSO OYJ	30	82	10,137	資本財・サービス
ELISA OYJ	35.5	107	13,179	電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS	103	443	54,582	金融
FORTUM OYJ	104.5	150	18,523	公益事業
KONE OYJ-B	78.5	329	40,508	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ	26.5	93	11,448	一般消費財・サービス
NESTE OYJ	29.5	105	13,005	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	20.5	86	10,664	ヘルスケア
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,073.5 12銘柄	2,569 < 0.4%>	-----
ユーロ (オーストリア)	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	35.5	121	14,890	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	66.5	190	23,395	金融
VOESTALPINE AG	28.5	109	13,509	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	24	43	5,355	金融
ANDRITZ AG	16	76	9,348	資本財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	170.5 5銘柄	540 < 0.1%>	-----
ユーロ (その他)	百株	千ユーロ	千円	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	52	160	19,787	生活必需品
STMICROELECTRONICS NV	153	159	19,629	情報技術
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	205 2銘柄	320 < 0.0%>	-----
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	53,908.8 234銘柄	81,238 < 11.8%>	-----
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	269,904.19 1,251銘柄	81,261,530 < 96.2%>	-----

(注1) 邦貨換算金額は、2016年12月19日現在の時価を対顧客直物電信売買相場
の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで
邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	2016年12月19日現在		
	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,197	552	65,032
SIMON PROPERTY GROUP INC	7,187	1,302	153,263
BOSTON PROPERTIES INC	3.6	447	52,654
GENERAL GROWTH PROPERTIES	13.6	354	41,737
VORNADO REALTY TRUST	3,827	395	46,525
EQUITY RESIDENTIAL	8.5	544	64,040
EQUINIX INC	1,608	562	66,202
AMERICAN TOWER CORP	9.75	1,031	121,341
HOT HOTELS & RESORTS INC	17,293	328	38,669
KIMCO REALTY CORP	10	255	30,007
VENTAS INC	7.9	482	56,806
WEYERHAEUSER CO	17,614	541	63,649
AGNC INVESTMENT CORP	7.8	139	16,395
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6.9	168	19,812
CROWN CASTLE INTL CORP	7.75	664	78,126
IRON MOUNTAIN INC	5.61	179	21,156
VEREIT INC	22.3	185	21,824
PROLOGIS INC	12,262	643	75,696
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.7	183	21,590
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	163	19,251
DUKE REALTY CORP	8	209	24,636
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.48	335	39,518
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1.6	224	26,398
WELLTOWER INC	8.3	540	63,637
HCP INC	10.7	311	36,676
LIBERTY PROPERTY TRUST	3.3	130	15,344
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.7	164	19,339
MACERICH CO/THE	3	209	24,621
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23.2	236	27,835
REALTY INCOME CORP	6	332	39,149
PUBLIC STORAGE	3.4	743	87,479
REGENCY CENTERS CORP	2.3	155	18,324
SL GREEN REALTY CORP	2.25	246	29,004
UDR INC	6.3	221	26,093
DIGITAL REALTY TRUST INC	3.7	349	41,168
EXTRA SPACE STORAGE INC	2.75	204	24,002
アメリカ・ドル 通 貨 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	258,378 36銘柄	1,617,016 <1.9%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	1.5	47	4,196
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3	65	5,794
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3.3	85	7,511
カナダ・ドル 通 貨 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	7.8 3銘柄	17,501 <0.0%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円
SCENTRE GROUP	121,922	531	45,636
DEXUS PROPERTY GROUP	23.95	219	18,833
GPT GROUP	40.06	193	16,645
MIRVAC GROUP	93.4	195	16,758
STOCKLAND	57	249	21,384
WESTFIELD CORP	45,496	406	34,918

銘柄	2016年12月19日現在		
	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千オーストラリア・ドル	千円
GOODMAN GROUP	41.7	289	24,880
VICINITY CENTRES	74.873	217	18,705
オーストラリア・ドル 通 貨 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	498,401 8銘柄	2,303 <0.2%>
(香港)	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT	52	2,610	39,547
香港・ドル 通 貨 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	52 1銘柄	2,610 <0.0%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	48	110	9,033
CAPITALAND MALL TRUST	63.2	120	9,808
SUNTEC REIT	53	87	7,124
シンガポール・ドル 通 貨 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	164.2 3銘柄	318 <0.0%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	18.2	187	27,539
SEGRO PLC	19.95	87	12,881
HAMMERSON PLC	17.4	96	14,148
BRITISH LAND CO PLC	22.1	139	20,421
INTU PROPERTIES PLC	21.1	57	8,462
イギリス・ポンド 通 貨 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	98.75 5銘柄	568 <0.1%>
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO SE	2.36	511	62,937
ICADE	0.75	49	6,118
GECINA SA	0.95	121	14,899
KLEPIERRE	5.2	187	23,011
FONCIERE DES REGIONS	0.75	60	7,411
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	10.01 5銘柄	929 <0.1%>
合 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	1,089,539 61銘柄	2,095,626 <2.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、2016年12月19日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄 別	2016年12月19日現在	
	買 建 額	売 建 額
外国 S & P 500 (アメリカ)	百万円 1,061	百万円 -

(注1) 外貨建の評価額は、2016年12月19日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の決算日（2016年9月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年12月19日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの組入資産の内容等を32～33ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの主要な売買銘柄
投資信託証券

(2016年5月13日から2016年12月19日まで)

買		付			売		付		
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
日本ビルファンド		5.267	3,334,898	633,168	日本ビルファンド		0.025	15,246	609,878
ジャパンリアルエステイト		4.884	3,035,820	621,584	ジャパンリアルエステイト		0.023	13,521	587,883
ユナイテッド・アーバン投資法人		16.662	2,993,277	179,646	野村不動産マスターＦ		0.075	12,479	165,955
野村不動産マスターＦ		14.413	2,419,828	167,892	日本リートールファンド		0.045	10,190	226,454
日本リートールファンド		9.52	2,361,155	248,020	ユナイテッド・アーバン投資法人		0.053	9,474	178,764
オリックス不動産投資		11.3	2,022,847	179,013	日本プロロジスリート		0.033	8,208	248,750
日本プロロジスリート		8.216	1,970,298	239,812	オリックス不動産投資		0.046	7,970	173,265
ＧＬＰ投資法人		15.365	1,966,623	127,993	大和ハウスリート投資法人		0.027	7,819	285,400
ジャパン・ホテル・リート投資法人		22.046	1,914,969	86,862	アドバンス・レジデンス		0.024	6,872	286,343
ＡＰＩ投資法人		3.574	1,865,479	521,958	日本プライムリアルティ		0.015	6,688	445,911

(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12月19日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（105,872,694千口）の内容です。

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

フ ア ン ド 名	2016年12月19日現在				フ ア ン ド 名	2016年12月19日現在			
	口数	評価額	比率			口数	評価額	比率	
不動産投信	千口	千円	%			千口	千円	%	
日本アコモデーションファンド投資法人	10.621	5,018,422	1.9		インベスコ・オフィス・リート	17.878	1,684,107	0.7	
MCUBS MidCity投資法人	5.832	2,003,292	0.8		日本ヘルスケア投資法	1.636	292,026	0.1	
森ヒルズリート	38.377	5,852,492	2.3		積水ハウス・リート投資	19.598	2,794,674	1.1	
産業ファンド	7.729	4,088,641	1.6		トーセイ・リート投資法人	4.016	434,129	0.2	
アドバンス・レジデンス	29.594	8,499,396	3.3		ケネディクス商業リート	9.261	2,324,511	0.9	
ケネディクスレジデンシャル	7.653	2,223,961	0.9		ヘルスケア&メディカル投資	2.642	274,503	0.1	
ＡＰＩ投資法人	14.483	7,603,575	2.9		サムティ・レジデンシャル	6.204	526,099	0.2	
ＧＬＰ投資法人	62.544	7,974,360	3.1		ジャパン・シニアリビング	1.858	263,092	0.1	
コンフォリア・レジデンシャル	11.257	2,723,068	1.1		野村不動産マスターＦ	91.701	15,910,123	6.2	
日本プロロジスリート	41.723	9,471,121	3.7		いちごホテルリート投資	5.647	724,510	0.3	
星野リゾート・リート	3.584	2,096,640	0.8		ラサールロジポート投資	24.114	2,544,027	1.0	
ＳＩＡ不動産投資	2.075	793,687	0.3		スターアジア不動産投	7.556	712,530	0.3	
イオンリート投資	28.706	3,588,250	1.4		マリモ地方創生リート	1.994	159,320	0.1	
ヒューリックリート投資法	22.908	4,194,454	1.6		三井不動産パーク	4.91	1,522,100	0.6	
日本リート投資法人	8.588	2,406,357	0.9		大江戸温泉リート	3.863	322,174	0.1	

フ ァ ン ド 名		2016年12月19日現在		
		□ 数	評 価 額	比 率
		千□ 千円		%
さくら総合リート		7.3	570,130	0.2
日本ビルファンド		30.953	19,469,437	7.5
ジャパンリアルエステイト		28.702	18,082,260	7.0
日本リートールファンド		55.948	12,923,988	5.0
オリックス不動産投資		55.344	9,884,438	3.8
日本プライムリアルティ		19.138	8,937,446	3.5
プレミア投資法人		28.871	3,828,294	1.5
東急リアル・エステート		21.431	2,963,907	1.1
グローバル・ワン不動産投資法人		4.248	1,777,788	0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人		66.708	11,513,800	4.5
森トラスト総合リート		28.936	5,199,799	2.0
インヴィンシブル投資法人		80.58	4,456,074	1.7
フロンティア不動産投資		10.873	5,458,246	2.1
平和不動産リート		22.247	1,757,513	0.7
日本ロジスティクスファンド投資法人		19.291	4,382,915	1.7
福岡リート投資法人		16.375	2,818,137	1.1
ケネディクス・オフィス投資法人		8.876	5,618,508	2.2
積水ハウス・ＳＩレジデンシャル投資法人		24.234	2,912,926	1.1
いちごオフィスリート投資法人		33.59	2,472,224	1.0
大和証券オフィス投資法人		10.914	6,166,410	2.4
阪急リート投資法人		13.098	1,874,323	0.7
スターツプロシード投資法人		5.629	848,853	0.3
大和ハウスリート投資法人		33.305	9,338,722	3.6
ジャパン・ホテル・リート投資法人		82.467	6,622,100	2.6
日本賃貸住宅投資法人		35.953	2,764,785	1.1
ジャパンエクセレント投資法人		28.623	4,021,531	1.6
合 計	□ 数、金 額	1,272.186	255,690,211	
	銘柄数<比率>	56銘柄		<98.9%>

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
 (注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘 柄 別		2016年12月19日現在	
		買 建 額	売 建 額
国内	東証ＲＥＩＴ	百万円 2,688	百万円 －

(注) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050）が投資対象としている「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の決算日（2016年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年12月19日）現在におけるダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を34～38ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄
投資信託証券

(2016年5月13日から2016年12月19日まで)

買					売				
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		7.6	159,103	20,934	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		0.4	8,664	21,662
PUBLIC STORAGE (アメリカ)		3.6	84,745	23,540	PUBLIC STORAGE (アメリカ)		0.2	5,089	25,449
PROLOGIS INC (アメリカ)		13.9	77,814	5,598	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		0.2	3,869	19,347
WELLTOWER INC (アメリカ)		9.7	71,923	7,414	WELLTOWER INC (アメリカ)		0.4	3,037	7,593
VENTAS INC (アメリカ)		9.7	68,791	7,091	PROLOGIS INC (アメリカ)		0.5	2,993	5,986
UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)		2.5	65,043	26,017	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		0.4	2,823	7,057
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		3.3	60,706	18,395	ESSEX PROPERTY TRUST INC (アメリカ)		0.1	2,539	25,396
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		8.7	58,698	6,746	VORNADO REALTY TRUST (アメリカ)		0.2	2,299	11,496
BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)		3.6	49,490	13,747	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		0.2	2,171	10,859
SCENTRE GROUP (オーストラリア)		136	48,929	359	VENTAS INC (アメリカ)		0.3	2,131	7,105

(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12月19日現在におけるダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド（2,861,359千口）の内容です。

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

ファンド名	2016年12月19日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド (シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
MANULIFE US REAL ESTATE INV (アメリカ)	24.9	20	2,431	0.0
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3.5	106	12,491	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	3.6	35	4,166	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	4.582	124	14,600	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	5.2	102	12,001	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6.6	1,141	134,255	2.2
SIMON PROPERTY GROUP INC	15.047	2,727	320,879	5.2
BOSTON PROPERTIES INC	7.4	920	108,233	1.8
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	7.855	346	40,812	0.7
GENERAL GROWTH PROPERTIES	29.377	766	90,157	1.5
VORNADO REALTY TRUST	8.664	895	105,328	1.7

ファンド名	2016年12月19日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	7.5	80	9,430	0.2
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	1.1	21	2,545	0.0
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1.6	33	3,963	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.8	16	1,993	0.0
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	4.069	98	11,635	0.2
QTS REALTY TRUST INC-CL A	2.2	103	12,165	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	17.5	1,120	131,848	2.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	7.5	146	17,247	0.3
EPR PROPERTIES	3.1	215	25,387	0.4
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	0.9	11	1,404	0.0
CITY OFFICE REIT INC	0.7	8	1,039	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	8.6	68	8,113	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	2.629	51	6,017	0.1

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ファンド名	2016年12月19日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
CHATHAM LODGING TRUST	1.7	36	4,237	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	2.7	72	8,470	0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1.1	49	5,783	0.1
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2.4	150	17,655	0.3
FOREST CITY REALTY TRUST- A	11	226	26,629	0.4
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	5.5	113	13,333	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	0.5	11	1,316	0.0
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	1.113	15	1,830	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	37.3	709	83,408	1.3
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	10.908	217	25,585	0.4
GRAMERCY PROPERTY TRUST	19.487	168	19,782	0.3
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	3.8	161	18,952	0.3
CORESITE REALTY CORP	1.7	131	15,487	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	6.1	208	24,568	0.4
RLJ LODGING TRUST	6	146	17,242	0.3
FARMLAND PARTNERS INC	0.5	5	631	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	6.5	119	14,106	0.2
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1.5	21	2,516	0.0
CYRUSONE INC	3.6	159	18,776	0.3
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	1.6	27	3,229	0.1
KIMCO REALTY CORP	21.4	545	64,215	1.0
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	7.15	203	23,961	0.4
WHITESTONE REIT	1.3	17	2,102	0.0
TIER REIT INC	2.1	34	4,073	0.1
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	1.9	2	350	0.0
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	1.1	11	1,372	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9.8	294	34,583	0.6
PARKWAY INC	2.188	43	5,152	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	7	141	16,682	0.3
COLONY STARWOOD HOMES	2.2	63	7,512	0.1
QUALITY CARE PROPERTIES	4.1	62	7,364	0.1
WASHINGTON PRIME GROUP INC	9.36	96	11,296	0.2
CORECIVIC INC	5.424	130	15,312	0.2
STORE CAPITAL CORP	7.9	190	22,414	0.4
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4.4	68	8,006	0.1
LIFE STORAGE INC	2.2	183	21,606	0.3
SELECT INCOME REIT	3.2	78	9,192	0.1
AMERICAN ASSETS TRUST INC	2	85	10,019	0.2
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	2.782	24	2,843	0.0
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1	13	1,616	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	6.2	123	14,535	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	3	69	8,172	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	5.6	118	13,938	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	3.8	87	10,280	0.2
VENTAS INC	17.879	1,092	128,562	2.1
CARETRUST REIT INC	2.903	44	5,200	0.1
NEW YORK REIT INC	7.7	73	8,704	0.1
GEO GROUP INC/THE	3.6	124	14,651	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	13.2	322	37,901	0.6
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	3.6	67	7,952	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	3.3	77	9,168	0.1

ファンド名	2016年12月19日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
UMH PROPERTIES INC	1	13	1,619	0.0
IRON MOUNTAIN INC	12.3	394	46,385	0.8
TERRENO REALTY CORP	2.3	65	7,716	0.1
VEREIT INC	49.108	408	48,061	0.8
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	24.4	257	30,337	0.5
SUN COMMUNITIES INC	3.33	246	28,938	0.5
ACADIA REALTY TRUST	4.111	133	15,716	0.3
ALEXANDER'S INC	0.2	86	10,174	0.2
PROLOGIS INC	26.646	1,398	164,491	2.7
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4	431	50,802	0.8
BRANDYWINE REALTY TRUST	8.4	131	15,513	0.3
SAUL CENTERS INC	0.6	39	4,688	0.1
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7.645	88	10,467	0.2
MACK-CALI REALTY CORP	4.3	120	14,122	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	4.4	360	42,352	0.7
COUSINS PROPERTIES INC	17.207	140	16,577	0.3
DDR CORP	15.456	232	27,344	0.4
DUKE REALTY CORP	17.9	468	55,124	0.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	1.6	116	13,646	0.2
EQUITY ONE INC	4.7	141	16,613	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3.167	718	84,565	1.4
FELCOR LODGING TRUST INC	6.5	52	6,200	0.1
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5.9	162	19,127	0.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3.6	504	59,395	1.0
GETTY REALTY CORP	1.103	27	3,221	0.1
WELLTOWER INC	18.3	1,192	140,308	2.3
HCP INC	23.6	687	80,894	1.3
HIGHWOODS PROPERTIES INC	5	249	29,319	0.5
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	8.3	253	29,836	0.5
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5.6	165	19,504	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	6.275	187	22,040	0.4
KILROY REALTY CORP	4.4	328	38,590	0.6
LASALLE HOTEL PROPERTIES	5.4	164	19,329	0.3
LIBERTY PROPERTY TRUST	7.4	292	34,409	0.6
LTC PROPERTIES INC	2	92	10,909	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	10.2	108	12,814	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5.728	553	65,161	1.1
MACERICH CO/THE	6.1	425	50,062	0.8
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3.8	269	31,732	0.5
NATL HEALTH INVESTORS INC	2	146	17,256	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7.4	313	36,864	0.6
REALTY INCOME CORP	13.017	722	84,935	1.4
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4.3	129	15,280	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	3.1	59	7,034	0.1
PUBLIC STORAGE	7.1	1,552	182,677	3.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1	114	13,423	0.2
REGENCY CENTERS CORP	5	338	39,835	0.6
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	3.5	57	6,747	0.1
ISTAR INC	3.2	39	4,663	0.1
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	4.6	160	18,851	0.3
SL GREEN REALTY CORP	5.1	558	65,744	1.1

ファンド名	2016年12月19日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
SENIOR HOUSING PROP TRUST	11.4	201	23,668	0.4
TAUBMAN CENTERS INC	3	222	26,131	0.4
URSTADT BIDDLE - CLASS A	1.5	36	4,262	0.1
UDR INC	13.5	475	55,913	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.6	38	4,496	0.1
WP CAREY INC	5.4	322	37,889	0.6
WASHINGTON REIT	3.8	123	14,513	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	5.9	207	24,359	0.4
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	3.6	26	3,163	0.1
AGREE REALTY CORP	1.2	53	6,298	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9.85	298	35,084	0.6
CUBESMART	9.1	236	27,863	0.5
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	10.026	156	18,433	0.3
DIGITAL REALTY TRUST INC	8	756	89,012	1.4
CEDAR REALTY TRUST INC	3.4	21	2,543	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	6	445	52,368	0.8
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	2.6	27	3,186	0.1
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2.075	44	5,198	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	5.4	36	4,293	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	4.25	100	11,848	0.2
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	3.5	49	5,825	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.7	17	2,055	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	6.7	324	38,215	0.6
EDUCATION REALTY TRUST INC	3.5	143	16,851	0.3
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1.1	20	2,450	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	9.642	108	12,816	0.2
NORTHSTAR REALTY FINANCE	8.65	130	15,394	0.2
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2.649	33	3,938	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	14.8	180	21,204	0.3
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5.4	69	8,175	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	7.3	266	31,359	0.5
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	4.6	215	25,399	0.4
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	12	181	21,371	0.3
アメリカ・ドル 通貨計	1,061,622 159銘柄	37,893	4,457,468	<72.1%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	3.5	42	3,778	0.1
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	2.6	23	2,114	0.0
SLATE RETAIL REIT - U	0.8	11	1,032	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1.5	17	1,550	0.0
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE	0.7	7	635	0.0
SLATE OFFICE REIT	1	7	680	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	1.6	15	1,406	0.0
BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	0.5	13	1,160	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1.1	49	4,338	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	1.1	8	791	0.0
ONEREIT	1	3	310	0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1.7	11	1,056	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	2.2	29	2,580	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	5.2	27	2,412	0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	0.7	9	834	0.0

ファンド名	2016年12月19日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千カナダ・ドル	千円	%
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	1.8	31	2,816	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1.4	20	1,845	0.0
PLAZA RETAIL REIT	2.3	11	973	0.0
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	3	95	8,392	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTATE	3.2	96	8,474	0.1
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	1.7	76	6,730	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	4.29	61	5,436	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	7.066	154	13,646	0.2
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	1.3	18	1,630	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8	206	18,209	0.3
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2.5	47	4,213	0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1.1	52	4,588	0.1
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	1.2	22	1,994	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1.9	25	2,267	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	2	70	6,190	0.1
カナダ・ドル 通貨計	67,956 30銘柄	1,271	112,093	< 1.8%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	9	22	1,916	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	61.5	58	5,015	0.1
GENERATION HEALTHCARE REIT	5.5	9	812	0.0
VIVA ENERGY REIT	20	46	4,000	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	8.5	34	2,962	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	34.5	75	6,486	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	9.5	30	2,601	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	23	34	3,001	0.0
INDUSTRIA REIT	6.5	13	1,171	0.0
GDI PROPERTY GROUP	21	20	1,775	0.0
360 CAPITAL OFFICE FUND	2.5	5	463	0.0
SCENTRE GROUP	268	1,168	100,314	1.6
ARENA REIT	10	18	1,575	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	6.5	17	1,517	0.0
BWP TRUST	22.5	65	5,621	0.1
DEXUS PROPERTY GROUP	48.5	444	38,139	0.6
GPT GROUP	90.5	438	37,604	0.6
INVESTA OFFICE FUND	31	141	12,135	0.2
CHARTER HALL RETAIL REIT	16	66	5,727	0.1
MIRVAC GROUP	186.5	389	33,463	0.5
STOCKLAND	121	528	45,394	0.7
WESTFIELD CORP	96.5	862	74,063	1.2
ABACUS PROPERTY GROUP	12	35	3,008	0.0
GOODMAN GROUP	80	556	47,732	0.8
VICINITY CENTRES	164.5	478	41,095	0.7
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	2.5	16	1,407	0.0
CHARTER HALL GROUP	20	91	7,881	0.1
ALE PROPERTY GROUP	8.5	36	3,115	0.1
ASPEN GROUP	3	3	260	0.0
INGENIA COMMUNITIES GROUP	8	21	1,854	0.0
360 CAPITAL GROUP LTD	9	7	664	0.0
オーストラリア・ドル 通貨計	1,406 31銘柄	5,740	492,785	< 8.0%>

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ファンド名	2016年12月19日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	千口	千香港ドル	千円	%
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	47	196	2,983	0.0
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	49	223	3,392	0.1
FORTUNE REIT	65	560	8,498	0.1
PROSPERITY REIT	54	164	2,487	0.0
LINK REIT	112	5,622	85,179	1.4
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	34	107	1,627	0.0
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	38	77	1,180	0.0
CHAMPION REIT	103	437	6,631	0.1
香港ドル計	502	7,391	111,980	
通貨計	8銘柄			< 1.8%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	37,728	47	3,842	0.1
FIRST REAL ESTATE INVST TRUST	23.8	30	2,481	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	87.7	82	6,751	0.1
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	25.2	32	2,607	0.0
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	52.5	48	3,956	0.1
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	107.5	160	13,093	0.2
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	118.8	274	22,357	0.4
CAPITALAND MALL TRUST	135.7	258	21,060	0.3
SUNTEC REIT	127.8	210	17,179	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	70.2	70	5,719	0.1
KEPPEL REIT	84.7	87	7,107	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	25.96	32	2,654	0.0
ASCOTT RESIDENCE TRUST	44.3	51	4,186	0.1
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	47,479	25	2,050	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS	32.3	42	3,434	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	27.3	52	4,236	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	64.8	48	3,933	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	33.2	45	3,705	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	18.6	44	3,606	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	85.7	32	2,618	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	56.98	94	7,705	0.1
CACHE LOGISTICS TRUST	39.3	32	2,609	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	85.3	119	9,763	0.2
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	35.8	21	1,749	0.0
SPH REIT	34.4	32	2,648	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	30.6	19	1,595	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	29.6	15	1,241	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	35.5	24	2,024	0.0
OUE HOSPITALITY TRUST	52.173	33	2,762	0.0
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	22.15	15	1,236	0.0
シンガポール・ドル計	1,673.07	2,085	169,921	
通貨計	30銘柄			< 2.7%>
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
STRIDE PROPERTY GROUP	17	29	2,441	0.0
INVESTORE PROPERTY LTD	10.25	13	1,135	0.0
ARGOSY PROPERTY LTD	36.5	36	2,965	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD	61.5	82	6,763	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	21	31	2,602	0.0
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	15.5	30	2,518	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	46.5	54	4,484	0.1

ファンド名	2016年12月19日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	48	56	4,628	0.1
ニュージーランド・ドル計	256.25	335	27,540	
通貨計	8銘柄			< 0.4%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	82.25	46	6,760	0.1
MUCKLOW (A&J) GROUP PLC	2.55	11	1,741	0.0
CAPITAL & REGIONAL PLC	20.65	10	1,615	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	22.85	24	3,575	0.1
REGIONAL REIT LTD	8.4	8	1,308	0.0
NEWRIVER REIT PLC	10.8	35	5,255	0.1
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	59.25	22	3,256	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	40.35	415	61,056	1.0
HANSTEEN HOLDINGS PLC	34.35	37	5,530	0.1
SEGRO PLC	41.75	183	26,956	0.4
HAMMERSON PLC	39.5	218	32,119	0.5
BRITISH LAND CO PLC	51.55	324	47,635	0.8
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	17.35	112	16,478	0.3
INTU PROPERTIES PLC	45.4	123	18,208	0.3
DERWENT LONDON PLC	5.6	152	22,336	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	27.55	30	4,452	0.1
WORKSPACE GROUP PLC	5.45	40	5,976	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	9.9	32	4,755	0.1
SHAFTESBURY PLC	14	124	18,284	0.3
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	4.4	7	1,150	0.0
BIG YELLOW GROUP PLC	7.1	46	6,800	0.1
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	31.65	47	6,928	0.1
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	22.45	12	1,863	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	53	71	10,488	0.2
イギリス・ポンド計	658.1	2,141	314,535	
通貨計	24銘柄			< 5.1%>
(イスラエル)	千口	千イスラエル・シェケル	千円	%
REIT 1 LTD	5.79	62	1,887	0.0
イスラエル・シェケル計	5.79	62	1,887	
通貨計	1銘柄			< 0.0%>
ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	15.15	17	2,161	0.0
GREEN REIT PLC	31.4	41	5,059	0.1
HIBERNIA REIT PLC	32.85	39	4,808	0.1
国小計	79.4	97	12,030	
通貨計	3銘柄			< 0.2%>
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千円	%
WERELDHAVE NV	1.95	79	9,790	0.2
EUROCOMMERCIAL PROPRIET-CV	2.45	86	10,627	0.2
NSI NV	6.45	23	2,830	0.0
VASTNED RETAIL NV	0.9	31	3,847	0.1
国小計	11.75	220	27,095	
通貨計	4銘柄			< 0.4%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千円	%
AEDIFICA	0.65	45	5,571	0.1
COFINIMMO	1	104	12,854	0.2
BEFIMMO	1.1	56	6,988	0.1

フ ァ ン ド 名		2016年12月19日現在			
		口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		千口	千ユーロ	千円	%
RETAIL ESTATES		0.55	12	1,566	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA		0.3	21	2,657	0.0
WERELDHAVE BELGIUM NV		0.75	61	7,531	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		0.1	9	1,227	0.0
MONTEA		0.15	5	625	0.0
		0.3	12	1,568	0.0
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	4.9 9銘柄	329	40,592	< 0.7%>
ユーロ（フランス）		千口	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO SE		5	1,084	133,342	2.2
ICADE		2.25	149	18,355	0.3
ALTAREA		0.15	27	3,328	0.1
GECINA SA		2.05	261	32,151	0.5
KLEPIERRE		10.45	375	46,244	0.7
FONCIERE DES REGIONS		2.5	200	24,703	0.4
MERCIALYS		2.8	51	6,284	0.1
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	25.2 7銘柄	2,149	264,410	< 4.3%>
ユーロ（ドイツ）		千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		4.95	55	6,837	0.1
HAMBORNER REIT AG		3.7	31	3,906	0.1
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	8.65 2銘柄	87	10,744	< 0.2%>
ユーロ（スペイン）		千口	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		4.35	29	3,670	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI		5.2	59	7,266	0.1
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		2.8	37	4,580	0.1
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		23.65	239	29,440	0.5
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	36 4銘柄	365	44,959	< 0.7%>
ユーロ（イタリア）		千口	千ユーロ	千円	%
BENI STABILI SPA		45.35	24	3,040	0.0
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		15.4	10	1,307	0.0
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	60.75 2銘柄	35	4,347	< 0.1%>
ユーロ通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	226.65 31銘柄	3,285	404,179	< 6.5%>
合 計	口数、金額 銘柄数<比率>	5,857.438 322銘柄	—	6,092,393	<98.6%>

（注1）邦貨換算金額は、2016年12月19日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

（注2）比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

（注3）評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050）が投資対象としている「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の決算日（2016年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年12月19日）現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の組入資産の内容等を39～41ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の主要な売買銘柄
公 社 債

(2016年5月13日から2016年12月19日まで)

買			付			売			付		
銘		柄	金		額	銘		柄	金		額
			千円						千円		
344	10年国債 0.1%	2026/9/20	181,967			363	2年国債 0.1%	2018/4/15	213,349		
127	5年国債 0.1%	2021/3/20	161,624			342	10年国債 0.1%	2026/3/20	146,136		
343	10年国債 0.1%	2026/6/20	155,916			335	10年国債 0.5%	2024/9/20	105,403		
128	5年国債 0.1%	2021/6/20	149,414			19-2	静岡県公債 1.93%	2017/6/28	102,133		
129	5年国債 0.1%	2021/9/20	136,487			28	公営企業 1.89%	2017/10/25	102,036		
368	2年国債 0.1%	2018/9/15	133,961			648	東京都公債 1.84%	2017/6/20	101,994		
362	2年国債 0.1%	2018/3/15	124,744			4	成田国際空港 1.7%	2017/12/20	101,803		
36	地方公共団体 0.892%	2022/5/27	104,477			653	東京都公債 1.54%	2017/12/20	101,674		
65	地方公共団体 0.535%	2024/10/28	103,989			10	首都高速道路 0.336%	2017/9/20	100,381		
28-1	静岡県公債 0.08%	2026/3/19	100,333			1	三菱ＵＦＪ信託ＢＫ 0.345%	2017/6/7	100,359		

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2016年12月19日現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）（11,776,318千円）の内容です。

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

2016年12月19日現在							
区 分	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちＢＢ格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	10,402,000	11,610,339	77.9	－	57.0	17.1	3.9
地方債証券	1,200,000	1,235,850	8.3	－	2.8	2.8	2.7
特殊債券(除く金融債券)	1,000,000	1,029,950	6.9	－	2.1	2.1	2.7
普通社債券	900,000	916,698	6.2	－	－	5.5	0.7
合 計	13,502,000	14,792,839	99.3	－	61.9	27.4	10.0

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

2016年12月19日現在					
区 分	銘柄	年利	額面金額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	362 2年国債	0.1000	124,000	124,534	2018/03/15
	364 2年国債	0.1000	20,000	20,093	2018/05/15
	365 2年国債	0.1000	53,000	53,248	2018/06/15
	366 2年国債	0.1000	80,000	80,388	2018/07/15
	368 2年国債	0.1000	133,000	133,694	2018/09/15
	114 5年国債	0.3000	62,000	62,548	2018/09/20
	296 10年国債	1.5000	35,000	36,040	2018/09/20
	40 20年国債	2.3000	51,000	53,231	2018/09/20
	370 2年国債	0.1000	10,000	10,056	2018/11/15
	116 5年国債	0.2000	163,000	164,240	2018/12/20
	297 10年国債	1.4000	20,000	20,633	2018/12/20
	298 10年国債	1.3000	61,000	62,809	2018/12/20
	300 10年国債	1.5000	8,000	8,299	2019/03/20
	41 20年国債	1.5000	40,000	41,495	2019/03/20
	42 20年国債	2.6000	22,000	23,367	2019/03/20
	119 5年国債	0.1000	21,000	21,139	2019/06/20
	301 10年国債	1.5000	35,000	36,446	2019/06/20
	302 10年国債	1.4000	54,000	56,096	2019/06/20
	120 5年国債	0.2000	10,000	10,096	2019/09/20
	121 5年国債	0.1000	35,000	35,241	2019/09/20
	43 20年国債	2.9000	14,000	15,176	2019/09/20
	122 5年国債	0.1000	15,000	15,106	2019/12/20
	305 10年国債	1.3000	100,000	104,318	2019/12/20
	123 5年国債	0.1000	80,000	80,572	2020/03/20
	306 10年国債	1.4000	10,000	10,493	2020/03/20
	44 20年国債	2.5000	32,000	34,718	2020/03/20
	45 20年国債	2.4000	20,000	21,634	2020/03/20
	124 5年国債	0.1000	110,000	110,790	2020/06/20
	308 10年国債	1.3000	100,000	104,929	2020/06/20
	309 10年国債	1.1000	103,000	107,354	2020/06/20
	46 20年国債	2.2000	19,000	20,542	2020/06/22
	125 5年国債	0.1000	180,000	181,353	2020/09/20
	310 10年国債	1.0000	30,000	31,241	2020/09/20
	311 10年国債	0.8000	42,000	43,421	2020/09/20
	47 20年国債	2.2000	23,000	24,991	2020/09/21
	126 5年国債	0.1000	124,000	124,969	2020/12/20
	312 10年国債	1.2000	94,000	98,864	2020/12/20
	48 20年国債	2.5000	9,000	9,933	2020/12/21
	127 5年国債	0.1000	159,000	160,286	2021/03/20
	313 10年国債	1.3000	75,000	79,423	2021/03/20
	314 10年国債	1.1000	77,000	80,886	2021/03/20
	49 20年国債	2.1000	4,000	4,372	2021/03/22
	50 20年国債	1.9000	30,000	32,539	2021/03/22
	128 5年国債	0.1000	147,000	148,193	2021/06/20
	315 10年国債	1.2000	90,000	95,175	2021/06/20
	316 10年国債	1.1000	56,000	58,968	2021/06/20
	51 20年国債	2.0000	25,000	27,341	2021/06/21
	129 5年国債	0.1000	135,000	136,124	2021/09/20
	317 10年国債	1.1000	40,000	42,239	2021/09/20
	318 10年国債	1.0000	33,000	34,690	2021/09/20
	52 20年国債	2.1000	19,000	20,965	2021/09/21
	319 10年国債	1.1000	129,000	136,533	2021/12/20
	320 10年国債	1.0000	35,000	36,868	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	13,000	14,414	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	14,000	15,593	2021/12/20
	321 10年国債	1.0000	65,000	68,606	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	33,000	34,657	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	41,000	45,421	2022/03/21
	324 10年国債	0.8000	88,000	92,121	2022/06/20
	56 20年国債	2.0000	12,000	13,359	2022/06/20
	57 20年国債	1.9000	24,000	26,586	2022/06/20
	325 10年国債	0.8000	137,000	143,670	2022/09/20
	58 20年国債	1.9000	35,000	38,956	2022/09/20
	59 20年国債	1.7000	3,000	3,314	2022/12/20
	328 10年国債	0.6000	60,000	62,364	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	40,000	42,630	2023/03/20
	329 10年国債	0.8000	45,000	47,415	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	16,000	16,864	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	30,000	33,573	2023/06/20
	330 10年国債	0.8000	81,000	85,459	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	63,000	65,617	2023/09/20

2016年12月19日現在					
区 分	銘柄	年利	額面金額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	64 20年国債	1.9000	35,000	39,553	2023/09/20
	332 10年国債	0.6000	118,000	122,996	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	42,000	47,600	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	30,000	33,790	2023/12/20
	333 10年国債	0.6000	153,000	159,476	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	19,000	21,583	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	25,000	28,942	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	12,000	13,805	2024/03/20
	334 10年国債	0.6000	156,000	162,711	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	18,000	21,190	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	17,000	19,758	2024/06/20
	335 10年国債	0.5000	55,000	56,976	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	53,000	61,456	2024/09/20
	336 10年国債	0.5000	48,000	49,779	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	65,000	66,373	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	30,000	34,701	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	22,000	25,622	2024/12/20
	338 10年国債	0.4000	145,000	149,289	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	14,000	16,369	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	25,000	28,820	2025/03/20
	339 10年国債	0.4000	137,000	141,115	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	17,000	19,668	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	14,000	16,316	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	20,000	23,478	2025/06/20
	340 10年国債	0.4000	135,000	139,114	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	39,000	45,643	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	28,000	33,013	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	136,000	138,982	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	25,000	29,590	2025/12/20
	84 20年国債	2.0000	27,000	31,715	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	40,000	40,146	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	31,000	36,847	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	6,000	7,242	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	20,000	23,956	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	152,000	152,573	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	33,000	39,998	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	15,000	18,039	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	180,000	180,522	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	37,000	44,651	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	12,000	14,597	2026/09/20
	92 20年国債	2.1000	45,000	54,041	2026/12/20
	93 20年国債	2.0000	18,000	21,511	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	29,000	34,951	2027/03/20
	95 20年国債	2.3000	30,000	36,893	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	23,000	27,806	2027/06/20
	97 20年国債	2.2000	25,000	30,598	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	34,000	41,252	2027/09/20
	99 20年国債	2.1000	43,000	52,326	2027/12/20
	100 20年国債	2.2000	35,000	43,124	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	18,000	22,577	2028/03/20
	102 20年国債	2.4000	10,000	12,585	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	21,000	26,191	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	24,000	29,388	2028/06/20
	105 20年国債	2.1000	38,000	46,662	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	16,000	19,832	2028/09/20
	107 20年国債	2.1000	43,000	52,944	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	43,000	51,929	2028/12/20
	109 20年国債	1.9000	35,000	42,364	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	22,000	27,157	2029/03/20
	111 20年国債	2.2000	35,000	43,720	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	29,000	35,870	2029/06/20
	113 20年国債	2.1000	66,000	81,842	2029/09/20
	114 20年国債	2.1000	45,000	55,937	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	22,000	27,626	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	9,000	11,555	2030/02/20
	116 20年国債	2.2000	27,000	33,967	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	37,000	46,069	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	4,000	5,097	2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	13,000	16,043	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	13,000	15,702	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	70,000	82,714	2030/06/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

2016年12月19日現在						
区 分	銘 柄	年利率	額面金額	評 価 額	償還年月日	
		%	千円	千円		
	121 20年国債	1.9000	56,000	68,508	2030/09/20	
	122 20年国債	1.8000	10,000	12,100	2030/09/20	
	4 30年国債	2.9000	8,000	10,887	2030/11/20	
	123 20年国債	2.1000	42,000	52,614	2030/12/20	
	124 20年国債	2.0000	25,000	30,979	2030/12/20	
	125 20年国債	2.2000	25,000	31,726	2031/03/20	
	126 20年国債	2.0000	21,000	26,072	2031/03/20	
	127 20年国債	1.9000	23,000	28,219	2031/03/20	
	5 30年国債	2.2000	8,000	10,155	2031/05/20	
	128 20年国債	1.9000	32,000	39,303	2031/06/20	
	129 20年国債	1.8000	28,000	33,999	2031/06/20	
	130 20年国債	1.8000	28,000	34,027	2031/09/20	
	131 20年国債	1.7000	33,000	39,636	2031/09/20	
	6 30年国債	2.4000	9,000	11,723	2031/11/20	
	132 20年国債	1.7000	25,000	30,066	2031/12/20	
	133 20年国債	1.8000	40,000	48,680	2031/12/20	
	134 20年国債	1.8000	25,000	30,466	2032/03/20	
	135 20年国債	1.7000	20,000	24,081	2032/03/20	
	136 20年国債	1.6000	20,000	23,772	2032/03/20	
	7 30年国債	2.3000	12,000	15,523	2032/05/20	
	137 20年国債	1.7000	18,000	21,683	2032/06/20	
	138 20年国債	1.5000	24,000	28,201	2032/06/20	
	139 20年国債	1.6000	32,000	38,075	2032/06/20	
	140 20年国債	1.7000	65,000	78,330	2032/09/20	
	8 30年国債	1.8000	5,000	6,107	2032/11/22	
	9 30年国債	1.4000	11,000	12,759	2032/12/20	
	141 20年国債	1.7000	48,000	57,903	2032/12/20	
	142 20年国債	1.8000	20,000	24,430	2032/12/20	
	10 30年国債	1.1000	15,000	16,677	2033/03/20	
	143 20年国債	1.6000	48,000	57,177	2033/03/20	
	144 20年国債	1.5000	24,000	28,220	2033/03/20	
	11 30年国債	1.7000	9,000	10,877	2033/06/20	
	145 20年国債	1.7000	65,000	78,501	2033/06/20	
	12 30年国債	2.1000	11,000	14,001	2033/09/20	
	146 20年国債	1.7000	62,000	74,886	2033/09/20	
	13 30年国債	2.0000	11,000	13,845	2033/12/20	
	147 20年国債	1.6000	74,000	88,202	2033/12/20	
	14 30年国債	2.4000	22,000	29,144	2034/03/20	
	148 20年国債	1.5000	59,000	69,356	2034/03/20	
	15 30年国債	2.5000	21,000	28,210	2034/06/20	
	149 20年国債	1.5000	63,000	74,028	2034/06/20	
	16 30年国債	2.5000	26,000	34,990	2034/09/20	
	150 20年国債	1.4000	61,000	70,639	2034/09/20	
	17 30年国債	2.4000	17,000	22,613	2034/12/20	
	151 20年国債	1.2000	65,000	72,994	2034/12/20	
	18 30年国債	2.3000	20,000	26,282	2035/03/20	
	152 20年国債	1.2000	61,000	68,424	2035/03/20	
	19 30年国債	2.3000	15,000	19,721	2035/06/20	
	153 20年国債	1.3000	65,000	73,991	2035/06/20	
	20 30年国債	2.5000	16,000	21,633	2035/09/20	
	154 20年国債	1.2000	67,000	75,038	2035/09/20	
	21 30年国債	2.3000	16,000	21,069	2035/12/20	
	155 20年国債	1.0000	63,000	68,169	2035/12/20	
	22 30年国債	2.5000	17,000	23,029	2036/03/20	
	156 20年国債	0.4000	63,000	61,195	2036/03/20	
	23 30年国債	2.5000	16,000	21,703	2036/06/20	
	157 20年国債	0.2000	77,000	71,748	2036/06/20	
	24 30年国債	2.5000	15,000	20,373	2036/09/20	
	158 20年国債	0.5000	63,000	62,051	2036/09/20	
	25 30年国債	2.3000	17,000	22,481	2036/12/20	
	26 30年国債	2.4000	32,000	42,979	2037/03/20	
	27 30年国債	2.5000	26,000	35,574	2037/09/20	
	28 30年国債	2.5000	34,000	46,744	2038/03/20	
	29 30年国債	2.4000	38,000	51,705	2038/09/20	
	30 30年国債	2.3000	40,000	53,820	2039/03/20	
	31 30年国債	2.2000	38,000	50,574	2039/09/20	
	32 30年国債	2.3000	42,000	57,030	2040/03/20	
	33 30年国債	2.0000	55,000	71,450	2040/09/20	
	34 30年国債	2.2000	45,000	60,753	2041/03/20	
	35 30年国債	2.0000	53,000	69,362	2041/09/20	
	36 30年国債	2.0000	59,000	77,448	2042/03/20	
	37 30年国債	1.9000	57,000	73,772	2042/09/20	
	38 30年国債	1.8000	35,000	44,573	2043/03/20	

2016年12月19日現在						
区 分	銘 柄	年利率	額面金額	評 価 額	償還年月日	
		%	千円	千円		
	39 30年国債	1.9000	37,000	48,106	2043/06/20	
	40 30年国債	1.8000	29,000	37,020	2043/09/20	
	41 30年国債	1.7000	29,000	36,327	2043/12/20	
	42 30年国債	1.7000	33,000	41,402	2044/03/20	
	43 30年国債	1.7000	37,000	46,496	2044/06/20	
	44 30年国債	1.7000	32,000	40,277	2044/09/20	
	45 30年国債	1.5000	40,000	48,339	2044/12/20	
	46 30年国債	1.5000	43,000	52,032	2045/03/20	
	47 30年国債	1.6000	44,000	54,442	2045/06/20	
	48 30年国債	1.4000	45,000	53,433	2045/09/20	
	49 30年国債	1.4000	39,000	46,362	2045/12/20	
	50 30年国債	0.8000	44,000	45,342	2046/03/20	
	51 30年国債	0.3000	40,000	35,912	2046/06/20	
	52 30年国債	0.5000	47,000	44,685	2046/09/20	
	1 40年国債	2.4000	24,000	35,459	2048/03/20	
	2 40年国債	2.2000	23,000	32,897	2049/03/20	
	3 40年国債	2.2000	19,000	27,311	2050/03/20	
	4 40年国債	2.2000	30,000	43,450	2051/03/20	
	5 40年国債	2.0000	35,000	48,758	2052/03/20	
	6 40年国債	1.9000	28,000	38,322	2053/03/20	
	7 40年国債	1.7000	31,000	40,577	2054/03/20	
	8 40年国債	1.4000	23,000	27,899	2055/03/20	
	9 40年国債	0.4000	35,000	30,726	2056/03/20	
種別	銘柄数	-----	238銘柄	-----		
小計	金額	-----	10,402,000	11,610,339	-----	
地方債証券						
	24-6 京都市5年	0.1370	100,000	100,248	2018/03/28	
	20-1 千葉市公債	1.5500	100,000	102,168	2018/04/25	
	660 東京都公債	1.5800	100,000	102,460	2018/06/20	
	20-6 北海道公債	1.7200	100,000	102,993	2018/08/29	
	21-2 埼玉県公債	1.5700	100,000	103,903	2019/05/27	
	76 共同発行地方	1.4000	100,000	103,716	2019/07/25	
	21-6 大阪市公債	1.5700	100,000	104,686	2019/11/25	
	21-35 兵庫県公債	1.4600	100,000	104,558	2020/01/22	
	116 共同発行地方	0.8000	100,000	104,237	2022/11/25	
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	103,807	2022/12/22	
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	104,062	2023/01/31	
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	99,009	2026/03/19	
種別	銘柄数	-----	12銘柄	-----		
小計	金額	-----	1,200,000	1,235,850	-----	
特殊債券 (除く金融債)						
	3 政保地方公共6年	0.4000	100,000	100,515	2018/01/30	
	30 国際協力銀行	1.8700	100,000	102,343	2018/03/20	
	56 政保道路機構	1.4000	100,000	101,929	2018/04/20	
	2 政保地方公営機	1.6000	100,000	103,136	2018/11/16	
	5 日本政策投資CO	1.7450	100,000	103,847	2019/03/20	
	98 政保道路機構	1.3000	100,000	104,121	2020/01/31	
	122 政保道路機構	0.9000	100,000	103,520	2020/11/30	
	36 地方公共団体	0.8920	100,000	104,414	2022/05/27	
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	103,490	2023/05/31	
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,632	2024/10/28	
種別	銘柄数	-----	10銘柄	-----		
小計	金額	-----	1,000,000	1,029,950	-----	
普通社債券						
	15 NTTドコモ	1.9600	100,000	102,859	2018/06/20	
	35 みずほBK	0.2850	100,000	100,535	2019/01/25	
	25 東日本高速道	0.2990	100,000	100,547	2019/03/20	
	27 東日本高速道	0.2480	100,000	100,492	2019/06/20	
	1 明治安田2014基	0.5100	100,000	100,568	2019/08/07	
	164 オリックス	1.1460	100,000	102,613	2019/08/07	
	62 トヨタファイナンス	0.2030	100,000	100,311	2019/12/20	
	70 東日本旅客鉄道	1.1930	100,000	104,029	2020/09/29	
	33 中日本高速道	1.0840	100,000	104,741	2021/09/17	
種別	銘柄数	-----	9銘柄	-----		
小計	金額	-----	900,000	916,698	-----	
合計	銘柄数	-----	269銘柄	-----		
小計	金額	-----	13,502,000	14,792,839	-----	

(注) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050）が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2016年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年12月19日）現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を42～57ページに併せて掲載いたしました。

■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2016年5月13日から2016年12月19日まで)

買			売		
銘	柄	付金 額	銘	柄	付金 額
		千円			千円
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% 2017/8/31	671,971
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)	0.625% 2017/9/30	558,858
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.75% 2018/4/30	441,508	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)	0.875% 2018/5/31	411,635	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	4.25% 2017/10/25	394,944
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)	0.625% 2017/5/31	364,282
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)	2.5% 2017/6/30	363,932
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.125% 2021/7/31	373,051	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.875% 2017/9/30	321,631
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.5% 2046/5/15	372,339	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.75% 2017/10/31	311,203
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.25% 2021/10/31	342,860	United Kingdom Gilt (イギリス)	1% 2017/9/7	307,951
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.125% 2021/9/30	338,838	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.875% 2017/8/31	307,705

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

■組入資産明細表

下記は、2016年12月19日現在における外国債券インデックスマザーファンド（58,881,648千口）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

2016年12月19日現在								
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちＢＢ格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
アメリカ	千アメリカ・ドル 593,941	千アメリカ・ドル 594,232	千円 69,899,532	% 43.9	% —	% 17.7	% 17.9	% 8.3
カナダ	千カナダ・ドル 34,456	千カナダ・ドル 37,439	3,301,791	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 34,814	千オーストラリア・ドル 37,212	3,194,674	2.0	—	1.2	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,167	千シンガポール・ドル 7,324	596,739	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 77,990	11,457,642	7.2	—	5.1	1.7	0.4
スイス	千スイス・フラン 2,792	千スイス・フラン 3,287	376,765	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 47,500	千デンマーク・クローネ 60,601	1,002,955	0.6	—	0.4	0.2	0.0
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 30,136	409,248	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 54,936	691,101	0.4	—	0.3	0.2	—

外国債券インデックスマザーファンド

2016年12月19日現在								
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
メキシコ	千メキシコ・ペソ 222,616	千メキシコ・ペソ 229,307	千円 1,320,811	% 0.8	% －	% 0.5	% 0.2	% 0.2
マレーシア	千マレーシア・リンギット 26,617	千マレーシア・リンギット 26,275	690,245	0.4	－	0.2	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 106,223	千南アフリカ・ランド 96,235	804,525	0.5	－	0.4	0.1	－
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 32,714	千ポーランド・ズロチ 33,266	924,155	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 9,747	1,199,063	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 29,823	3,668,597	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 31,947	3,929,907	2.5	－	1.8	0.5	0.2
ユーロ (フランス)	千ユーロ 106,189	千ユーロ 125,974	15,496,158	9.7	－	6.0	2.8	0.9
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 79,796	千ユーロ 94,777	11,658,637	7.3	－	4.2	2.2	1.0
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 58,738	千ユーロ 69,548	8,555,136	5.4	－	3.3	1.5	0.5
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 105,363	千ユーロ 121,935	14,999,325	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 7,581	932,574	0.6	－	0.4	0.2	0.0
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 16,049	千ユーロ 19,429	2,389,999	1.5	－	1.0	0.4	0.1
ユーロ (小計)	432,060	510,766	62,829,400	39.4	－	24.1	11.3	4.0
合 計	－	－	157,499,588	98.9	－	51.6	33.4	13.9

(注1) 邦貨換算金額は、2016年12月19日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

2016年12月19日現在								
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.5000%	千アメリカ・ドル 3,839	千アメリカ・ドル 3,946	千円 464,189	2018/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.8750	2,960	3,074	361,701	2018/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.0000	3,173	3,321	390,718	2018/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.7500	2,488	2,604	306,345	2018/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	3,161	3,255	382,894	2019/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	3,096	3,220	378,789	2019/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.6250	2,621	2,766	325,444	2019/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.3750	4,020	4,226	497,197	2019/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.6250	4,280	4,541	534,212	2020/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.5000	3,073	3,251	382,529	2020/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	2,854	2,934	345,233	2020/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	4,509	4,637	545,472	2020/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	883	894	105,181	2017/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	924	940	110,659	2017/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	255	259	30,528	2018/01/31	

2016年12月19日現在							
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.6250	4,076	4,351	511,895	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	1,234	1,258	148,062	2018/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	1,300	1,328	156,310	2018/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	260	265	31,203	2018/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	2,551	2,671	314,291	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	1,322	1,344	158,178	2018/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	1,065	1,084	127,520	2018/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	1,341	1,363	160,434	2018/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	2,534	2,540	298,888	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	3,444	3,460	407,046	2018/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,835	2,841	334,288	2018/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	1,320	1,332	156,726	2018/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,153	2,143	252,107	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,165	2,169	255,196	2018/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	1,861	1,864	219,292	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	1,426	1,423	167,451	2019/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	3,224	3,201	376,645	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	1,843	1,843	216,841	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	300	300	35,397	2019/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	559	557	65,531	2019/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,459	2,401	282,538	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	2,385	2,368	278,594	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	1,368	1,353	159,157	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	1,784	1,756	206,662	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,543	2,458	289,246	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	1,872	1,847	217,371	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,215	2,184	256,936	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	884	877	103,192	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	3,168	3,053	359,143	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	2,336	2,329	274,063	2017/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	1,353	1,331	156,633	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	1,913	1,908	224,533	2017/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	1,894	1,868	219,761	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	2,153	2,149	252,900	2018/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	1,366	1,355	159,451	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	3,850	3,779	444,560	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	3,447	3,434	404,043	2018/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	1,968	1,943	228,583	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,315	2,305	271,153	2018/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	1,160	1,139	134,072	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	4,685	4,511	530,728	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	4,218	4,189	492,789	2018/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	1,451	1,423	167,453	2020/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	3,407	3,400	399,947	2018/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,461	2,432	286,114	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	1,693	1,698	199,792	2018/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	2,131	2,141	251,862	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,827	2,848	335,083	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	1,697	1,702	200,208	2018/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	3,768	3,792	446,066	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	1,993	2,014	237,017	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	1,885	1,896	223,100	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	3,611	3,610	424,693	2018/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,345	2,337	274,915	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	5,021	5,130	603,442	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	2,638	2,637	310,221	2018/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,501	2,511	295,478	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,026	2,034	239,285	2018/12/31

外国債券インデックスマザーファンド

2016年12月19日現在							
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	2,006	2,043	240,390	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	5,229	5,340	628,225	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,185	2,192	257,882	2019/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	1,647	1,659	195,174	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,373	2,380	280,006	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	1,734	1,737	204,415	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,383	2,396	281,932	2019/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,821	2,854	335,826	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	5,412	5,431	638,899	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,975	2,989	351,698	2019/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,407	2,433	286,252	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,241	2,245	264,112	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,732	2,730	321,188	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,885	2,897	340,872	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	3,485	3,497	411,379	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	8.8750	904	1,051	123,646	2019/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	8.1250	724	849	99,904	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	8.7500	642	800	94,126	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	8.0000	2,106	2,685	315,844	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.2500	654	811	95,500	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.0000	855	1,093	128,662	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.5000	630	844	99,303	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.1250	709	940	110,588	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.5000	700	894	105,180	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.2500	738	926	109,024	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.2500	473	595	70,100	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.2500	964	1,343	158,044	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.3750	1,241	1,626	191,379	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.5000	1,926	2,394	281,705	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.0000	547	721	84,812	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	548	668	78,632	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.5000	1,019	1,263	148,660	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.5000	849	910	107,084	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.2500	1,121	1,335	157,071	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.5000	760	936	110,155	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	1,210	1,465	172,354	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.6250	1,710	2,144	252,234	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	1,478	1,790	210,610	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.8750	1,591	1,791	210,761	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.2500	1,469	1,749	205,777	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.7500	1,754	2,242	263,835	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	1,365	1,656	194,872	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.7500	1,367	1,509	177,619	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	1,450	1,442	169,642	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	1,623	1,614	189,928	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	1,853	1,800	211,836	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	1,731	1,602	188,488	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	3,030	2,798	329,184	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	2,026	2,008	236,287	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	3,998	3,774	444,047	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.6250	3,314	3,597	423,140	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.7500	3,581	3,974	467,467	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.6250	3,617	3,924	461,632	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.3750	3,357	3,482	409,660	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	3,326	3,339	392,794	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,834	2,857	336,173	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	5,662	5,621	661,305	2024/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	3,729	3,689	433,979	2044/08/15

2016年12月19日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,989	2,998	352,763	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	1,301	1,296	152,504	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	3,404	3,424	402,851	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	3,625	3,631	427,137	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	3,190	3,185	374,710	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,163	2,152	253,240	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	5,921	5,813	683,804	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	3,696	3,566	419,574	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	2,886	2,856	335,976	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	4,325	4,316	507,732	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	1,517	1,517	178,541	2017/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	3,169	3,171	373,086	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,204	2,206	259,518	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	1,547	1,545	181,751	2018/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	3,963	3,917	460,774	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,427	2,352	276,743	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	5,743	5,518	649,101	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	3,763	3,269	384,544	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	1,961	1,960	230,564	2018/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,788	2,762	324,928	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	1,809	1,772	208,536	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,081	2,079	244,604	2018/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,792	2,763	325,086	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,083	2,072	243,844	2018/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,891	2,830	332,947	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,180	2,175	255,961	2018/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	5,788	5,601	658,926	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	4,035	3,886	457,170	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,607	2,577	303,211	2020/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,612	2,554	300,431	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	2,826	2,778	326,864	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	3,013	2,987	351,456	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	2,196	2,194	258,142	2018/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	3,001	2,986	351,323	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	2,821	2,806	330,148	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	2,189	2,177	256,194	2018/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	3,135	3,115	366,520	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,179	2,151	253,029	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	6,143	5,871	690,698	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	3,573	3,354	394,549	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	14	13	1,641	2018/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	2,445	2,395	281,738	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,868	2,822	331,985	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,179	2,170	255,323	2018/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,472	2,402	282,624	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,876	2,827	332,620	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	2,057	2,043	240,365	2018/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	5,840	5,685	668,816	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	3,116	3,059	359,889	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	3,709	3,571	420,098	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	2,558	2,502	294,313	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	2,138	2,137	251,462	2018/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	2,277	2,276	267,789	2017/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	3,096	3,064	360,424	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,687	2,644	311,033	2022/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	2,151	2,149	252,852	2018/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	3,043	3,023	355,653	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,276	2,276	267,819	2017/12/31

外国債券インデックスマザーファンド

2016年12月19日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	2,492	2,467	290,246	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	2,146	2,137	251,416	2019/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	3,126	3,055	359,463	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	5,366	4,943	581,539	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,329	2,322	273,198	2018/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,065	2,039	239,935	2019/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,561	2,478	291,553	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	3,428	2,970	349,395	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,100	2,083	245,120	2019/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	3,309	3,197	376,159	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,262	2,153	253,315	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	3,002	2,912	342,556	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	700	698	82,131	2018/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,123	2,017	237,376	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	1,125	1,111	130,788	2019/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	5,529	5,077	597,273	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,450	2,386	280,717	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	4,300	4,278	503,259	2018/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,070	1,980	232,936	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	3,423	2,964	348,696	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	2,507	2,475	291,153	2019/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	4,000	3,985	468,807	2018/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,700	2,627	309,038	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,500	2,388	280,932	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	2,100	2,070	243,596	2019/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	1,000	992	116,705	2018/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	2,500	2,402	282,585	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	3,000	2,818	331,494	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,500	2,455	288,802	2019/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	5,600	5,071	596,609	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	3,480	2,848	335,026	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,500	2,452	288,502	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,200	2,182	256,733	2018/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	3,700	3,546	417,208	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	1,770	1,757	206,716	2018/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	3,700	3,549	417,547	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	2,780	2,587	304,398	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,400	2,248	264,444	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	2,600	2,555	300,638	2019/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	3,000	2,973	349,812	2018/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,505	2,344	275,760	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	3,042	2,911	342,508	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,147	2,116	248,909	2019/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,326	2,304	271,051	2018/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,200	2,086	245,440	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	3,000	2,886	339,543	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,500	2,377	279,691	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	1,600	1,506	177,179	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	1,400	1,377	162,063	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	1,000	995	117,054	2018/11/30
通貨小計	銘 柄 数 金 額	239銘柄		593,941	594,232	69,899,532	
カナダ	Canada Government International Bond	国 債 証 券	2.7500	325	357	31,487	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	8.0000	386	606	53,524	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	983	1,373	121,168	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	1,127	1,657	146,199	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.0000	1,192	1,689	148,954	2037/06/01

2016年12月19日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	969	1,017	89,729	2018/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	1,524	1,630	143,768	2019/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,413	1,813	159,952	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	1,476	1,598	140,959	2020/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	956	1,041	91,825	2021/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,351	1,449	127,851	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	1,491	1,816	160,233	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,253	1,253	110,537	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,265	1,273	112,296	2018/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,021	1,028	90,711	2018/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,405	1,491	131,493	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	853	869	76,698	2019/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,627	1,663	146,671	2019/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	847	908	80,157	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,156	1,202	106,040	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	829	841	74,229	2020/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,772	1,783	157,286	2018/02/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	931	919	81,081	2020/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,029	999	88,183	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	1,237	1,216	107,248	2021/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,284	1,275	112,475	2018/05/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	1,480	1,449	127,793	2021/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,344	1,337	117,943	2018/08/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	390	355	31,338	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	800	795	70,139	2018/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	340	326	28,784	2022/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	400	397	35,025	2019/02/01	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	32銘柄		34,456	37,439	3,301,791		
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル			
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.2500	2,455	2,635	226,244	2019/03/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	2,420	2,785	239,097	2021/05/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	2,209	2,386	204,838	2020/04/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	2,032	2,394	205,556	2022/07/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	2,063	2,147	184,338	2018/01/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	2,068	2,434	209,041	2023/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	2,589	3,031	260,266	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	2,173	2,192	188,199	2024/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,314	1,341	115,129	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	2,398	2,490	213,814	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	958	1,102	94,613	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,197	1,228	105,435	2018/10/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	2,848	3,191	274,024	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,511	1,545	132,662	2019/10/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	863	885	76,004	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	557	500	42,994	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,495	1,475	126,686	2020/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	412	385	33,082	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,592	1,569	134,733	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	978	911	78,287	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	682	578	49,623	2047/03/21	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	21銘柄		34,814	37,212	3,194,674		
シンガポール				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル			
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	4.0000	491	512	41,754	2018/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.2500	696	732	59,640	2020/09/01	

外国債券インデックスマザーファンド

2016年12月19日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.5000	千シンガポール・ドル 442	千シンガポール・ドル 478	千円 38,980	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.1250	438	459	37,435	2022/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.5000	599	612	49,879	2019/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.0000	503	521	42,524	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.8750	359	361	29,445	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.2500	495	501	40,839	2021/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	400	394	32,115	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	0.5000	504	498	40,625	2018/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	491	503	40,981	2023/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.3750	238	254	20,743	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.8750	125	126	10,331	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	1.6250	270	270	21,999	2019/10/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.3750	224	222	18,088	2025/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.0000	224	225	18,400	2020/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	228	224	18,280	2046/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.1250	250	241	19,702	2026/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	1.2500	190	183	14,969	2021/10/01	
通貨小計	銘 柄 数 額 金	19銘柄		7,167	7,324	596,739		
イギリス	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	2.0000	千イギリス・ポンド 2,380	千イギリス・ポンド 2,509	368,666	2020/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	2.0000	2,121	2,241	329,232	2025/09/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.5000	2,477	2,568	377,396	2021/01/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	2.5000	1,182	1,407	206,814	2065/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.5000	945	948	139,413	2026/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.5000	60	58	8,631	2022/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.5000	400	351	51,612	2047/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.7500	200	189	27,810	2037/09/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	8.0000	1,102	1,464	215,093	2021/06/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	6.0000	949	1,403	206,170	2028/12/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,840	2,431	357,139	2032/06/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	5.0000	1,472	1,906	280,045	2025/03/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	2,032	2,762	405,839	2036/03/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.7500	1,457	2,155	316,683	2038/12/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.7500	1,724	1,967	289,085	2020/03/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,708	2,798	411,136	2055/12/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,666	2,471	363,040	2046/12/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,232	1,565	229,915	2027/12/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	5.0000	1,604	1,699	249,617	2018/03/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.5000	1,666	2,478	364,093	2042/12/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.7500	1,500	2,055	301,944	2030/12/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,373	2,111	310,246	2049/12/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.5000	1,573	1,724	253,366	2019/03/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,246	1,737	255,299	2039/09/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.0000	1,232	1,439	211,454	2022/03/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.5000	1,870	2,585	379,830	2034/09/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	3.7500	1,428	1,565	229,927	2019/09/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.0000	1,244	2,016	296,210	2060/01/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	3.7500	1,795	2,014	295,954	2020/09/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,577	2,223	326,641	2040/12/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	3.7500	1,633	1,869	274,690	2021/09/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	3.7500	1,182	1,716	252,240	2052/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.7500	2,242	2,354	345,939	2022/09/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	3.2500	2,156	2,665	391,646	2044/01/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.2500	2,854	2,905	426,786	2018/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	2.2500	1,942	2,098	308,351	2023/09/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	3.5000	1,621	2,473	363,427	2068/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.7500	2,161	2,245	329,949	2019/07/22	

2016年12月19日現在									
区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
		United Kingdom Gilt	国 債 証 券	%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
		United Kingdom Gilt	国 債 証 券	2.7500	1,842	2,057	302,242	2024/09/07	
				3.5000	2,124	2,750	404,056	2045/01/22	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	40銘柄			62,812	77,990	11,457,642		
		SWISS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	404	514	58,960	2023/02/11	
		SWISS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	497	720	82,558	2028/04/08	
		SWISS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	605	630	72,272	2018/01/08	
		SWISS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	517	565	64,860	2019/05/12	
		SWISS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	407	451	51,714	2020/07/06	
		SWISS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	362	404	46,397	2021/04/28	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	6銘柄			2,792	3,287	376,765		
		DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	7.0000	1,864	2,872	47,543	2024/11/10	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	11,512	19,548	323,533	2039/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	8,601	9,738	161,170	2019/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	8,650	10,035	166,085	2021/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	5,846	6,415	106,172	2021/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	7,863	8,775	145,234	2025/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	3,164	3,215	53,214	2018/11/15	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	7銘柄			47,500	60,601	1,002,955		
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	6,075	6,621	89,922	2019/05/22	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	6,698	7,464	101,367	2021/05/25	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	4,824	5,005	67,969	2023/05/24	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	4,095	4,513	61,289	2024/03/14	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	3,395	3,436	46,661	2025/03/13	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	3,140	3,095	42,037	2026/02/19	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	6銘柄			28,227	30,136	409,248		
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.0000	8,095	9,834	123,719	2020/12/01	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	8,385	9,321	117,258	2019/03/12	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	4,155	5,602	70,480	2039/03/30	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	8,165	9,768	122,882	2022/06/01	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	7,025	7,663	96,405	2023/11/13	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	5,495	6,452	81,178	2025/05/12	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	6,080	6,293	79,176	2026/11/12	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	7銘柄			47,400	54,936	691,101		
		Mexican Bonos	国 債 証 券	5.0000	15,647	14,949	86,107	2019/12/11	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	5.7500	7,590	6,790	39,112	2026/03/05	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	8,233	8,601	49,544	2023/12/07	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	10.0000	22,119	25,779	148,488	2024/12/05	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	7.5000	8,568	8,617	49,635	2027/06/03	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	13,756	13,962	80,421	2017/12/14	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	10.0000	6,874	8,505	48,991	2036/11/20	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	8.5000	8,844	9,534	54,919	2029/05/31	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	8.5000	22,092	22,900	131,904	2018/12/13	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	8.5000	9,694	10,551	60,774	2038/11/18	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	12,728	13,229	76,201	2020/06/11	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	6.5000	23,826	23,481	135,256	2021/06/10	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	13,015	13,150	75,747	2031/05/29	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	6.5000	11,399	11,158	64,270	2022/06/09	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	14,654	14,851	85,544	2042/11/13	

外国債券インデックスマザーファンド

2016年12月19日現在								
区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
		Mexican Bonos	国 債 証 券	4.7500	16,633	16,237	93,526	2018/06/14
				7.7500	6,944	7,007	40,365	2034/11/23
通貨小計	銘 柄 数 金 額	17銘柄			222,616	229,307	1,320,811	
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.2400	1,210	1,217	31,974	2018/02/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	5.7340	647	678	17,833	2019/07/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.5020	573	525	13,794	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	5.2480	738	779	20,469	2028/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.3780	1,603	1,630	42,832	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.4980	1,178	1,155	30,359	2030/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.1600	1,916	1,943	51,046	2021/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.3920	1,514	1,503	39,488	2026/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.2320	420	397	10,448	2031/06/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.5800	1,595	1,596	41,929	2018/09/28
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.4180	875	842	22,135	2022/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8920	731	694	18,252	2027/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.1270	618	577	15,158	2032/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.4920	1,044	1,034	27,172	2020/03/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.2600	533	531	13,949	2027/03/01
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.4800	1,001	959	25,206	2023/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8440	477	428	11,264	2033/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.7330	586	540	14,208	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8890	656	655	17,226	2020/07/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.9350	600	602	15,832	2043/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.1810	1,057	1,049	27,573	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.0480	857	863	22,692	2021/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.6540	648	645	16,962	2019/10/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.9550	737	711	18,683	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.6590	700	692	18,186	2020/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.7950	1,161	1,137	29,889	2022/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.2540	620	583	15,320	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.7590	768	770	20,247	2019/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8000	702	686	18,036	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.7360	450	441	11,611	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.9000	50	48	1,269	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.6200	352	349	9,188	2021/11/30
通貨小計	銘 柄 数 金 額	32銘柄			26,617	26,275	690,245	
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	8.0000	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	7.2500	4,178	4,179	34,937	2018/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	7.2500	5,768	5,618	46,966	2020/01/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	10.5000	15,434	16,946	141,673	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	6.2500	7,612	5,406	45,197	2036/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	6.7500	6,122	5,770	48,238	2021/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	6.5000	8,904	6,270	52,418	2041/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	7.0000	8,999	7,320	61,197	2031/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	7.7500	4,639	4,426	37,002	2023/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	8.7500	10,852	9,846	82,314	2048/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	8.5000	8,621	7,713	64,488	2037/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	8.0000	7,862	7,035	58,819	2030/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	8.7500	6,544	5,935	49,618	2044/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	8.2500	5,943	5,316	44,449	2032/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	8.8750	3,166	2,975	24,871	2035/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国 債 証 券	9.0000	1,579	1,474	12,330	2040/01/31
通貨小計	銘 柄 数 金 額	15銘柄			106,223	96,235	804,525	

2016年12月19日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
ポーランド	Poland Government Bond	国 債 証 券	5.7500	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	2022/09/23	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	5.5000	2,309	2,646	73,509	2019/10/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	1.5000	1,912	2,079	57,762	2020/04/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.5000	2,078	2,019	56,093	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.0000	3,377	3,115	86,556	2021/04/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	—	2,127	2,071	57,539	2018/10/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	1.7500	1,668	1,609	44,712	2021/07/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.5000	3,051	2,926	81,307	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.2500	900	822	22,854	2022/04/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	5.7500	700	676	18,804	2029/04/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	5.2500	627	758	68,863	2020/10/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	5.7500	2,256	2,478	27,838	2021/10/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	4.0000	884	1,002	75,371	2023/10/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	3.7500	2,575	2,713	49,062	2018/04/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.5000	1,720	1,766	58,939	2019/07/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	3.2500	2,099	2,121	52,474	2025/07/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	3.2500	1,840	1,888	71,402		
	Poland Government Bond	国 債 証 券	3.2500	2,591	2,570			
通貨小計	銘 柄 数 額	17銘柄		32,714	33,266	924,155		
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国 債 証 券	4.5000	千ユーロ	千ユーロ		2018/10/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	4.4000	759	829	102,041	2019/06/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	5.9000	684	768	94,572	2019/10/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	5.4000	570	673	82,875	2025/03/13	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	5.0000	1,131	1,557	191,617	2020/10/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	3.9000	765	922	113,477	2023/03/20	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	3.4000	504	620	76,323	2024/03/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	2.4000	607	733	90,215	2030/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	0.8000	761	867	106,770	2022/03/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	2.0000	516	537	66,166	2045/02/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.0000	531	552	68,003	2026/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	4.5000	473	478	58,865	2020/04/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	4.5000	1,035	1,204	148,132		
国 小 計	銘 柄 数 額	12銘柄		8,336	9,747	1,199,063		
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	7.5000	千ユーロ	千ユーロ		2023/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	548	805	99,107	2028/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,239	1,899	233,616	2037/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	1,355	2,121	260,995	2023/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	791	982	120,889	2018/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,544	1,659	204,141	2019/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,347	1,511	185,965	2020/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	1,146	1,316	161,938	2042/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	1,349	2,154	265,018	2021/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,463	1,714	210,865	2022/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,438	1,641	201,903	2033/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,168	1,464	180,205	2018/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,477	1,508	185,575	2023/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,385	1,551	190,830	2019/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	924	961	118,322	2047/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,004	1,412	173,735	2024/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	1,514	1,727	212,476	2020/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,374	1,412	173,785	2018/04/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,323	1,335	164,276	2025/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,291	1,284	157,961	2026/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	948	951	117,007	2022/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	400	406	49,979		
国 小 計	銘 柄 数 額	21銘柄		25,028	29,823	3,668,597		

外国債券インデックスマザーファンド

2016年12月19日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
ユーロ（ベルギー）	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.8000	千ユーロ 1,399	千ユーロ 1,440	千円 177,183	2025/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.0000	924	911	112,080	2031/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.9000	558	613	75,527	2038/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.0000	1,283	1,326	163,197	2026/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.6000	544	534	65,759	2047/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	2.1500	290	306	37,764	2066/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.2000	150	151	18,584	2023/10/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	5.5000	1,706	2,588	318,417	2028/03/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	5.0000	1,704	2,777	341,656	2035/03/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.0000	1,377	1,690	207,968	2022/03/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.0000	966	1,024	125,975	2018/03/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.0000	1,121	1,240	152,534	2019/03/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	3.7500	1,736	2,017	248,126	2020/09/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.2500	1,474	2,328	286,487	2041/03/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.2500	1,446	1,765	217,136	2021/09/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.5000	801	1,092	134,411	2026/03/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.2500	1,316	1,654	203,550	2022/09/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.0000	680	959	118,026	2032/03/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	3.0000	1,123	1,235	151,945	2019/09/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	2.2500	1,338	1,538	189,191	2023/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.2500	1,052	1,082	133,174	2018/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	3.7500	753	1,130	139,015	2045/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	2.6000	1,505	1,770	217,818	2024/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	3.0000	597	767	94,373	2034/06/22	
国 小 計	銘 柄 数 金 額	24銘柄		25,843	31,947	3,929,907		
ユーロ（フランス）	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	8.5000	千ユーロ 653	千ユーロ 823	101,291	2019/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	8.5000	685	1,052	129,522	2023/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.0000	2,225	3,287	404,431	2025/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	2,623	4,014	493,852	2029/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	2,507	4,164	512,284	2032/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	2,709	4,231	520,558	2035/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	3,075	3,430	421,932	2019/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,564	2,535	311,850	2055/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	3,230	3,804	468,005	2021/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	2,424	3,579	440,331	2038/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	3,697	4,738	582,885	2023/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	2,931	3,116	383,418	2018/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	2,567	2,802	344,785	2018/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	2,484	3,960	487,234	2041/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	3,263	3,668	451,221	2019/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	3,380	3,833	471,537	2020/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,017	1,689	207,880	2060/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	3,146	3,957	486,848	2026/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	3,113	3,461	425,856	2020/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	3,550	4,150	510,577	2021/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	3,480	4,066	500,188	2022/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	3,099	3,706	455,947	2027/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	2,694	3,053	375,665	2022/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	2,114	2,165	266,325	2018/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	2,088	2,827	347,798	2045/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	3,347	3,706	455,932	2023/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	1,920	1,982	243,807	2018/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	3,086	3,539	435,407	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	1,764	1,834	225,703	2019/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	2,787	3,284	404,023	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	2,799	3,104	381,903	2024/11/25	

2016年12月19日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	2019/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,322	2,394	294,489	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,792	2,794	343,749	2020/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	3,070	3,116	383,335	2018/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,335	1,345	165,530	2025/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	2,101	2,172	267,179	2020/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	2,193	2,246	276,305	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	2,020	2,111	259,756	2019/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,592	1,614	198,571	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,737	2,685	330,365	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	879	853	104,986	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	257	244	30,084	2021/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,170	2,195	270,012	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,600	1,519	186,916	2022/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,100	1,104	135,863		
国 小 計	銘 柄 数 額	45銘柄		106,189	125,974	15,496,158		
ユーロ (ドイツ)	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.2500	千ユーロ	千ユーロ		2024/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.5000	1,174	1,703	209,498	2027/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.6250	1,067	1,744	214,605	2028/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	1,362	2,130	262,083	2028/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.2500	950	1,408	173,290	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.2500	951	1,638	201,529	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	1,448	2,406	296,007	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	1,775	2,945	362,302	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	2,071	3,275	402,877	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	1,225	2,057	253,115	2018/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,798	1,889	232,431	2018/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	2,211	2,384	293,325	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	1,399	2,526	310,724	2019/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	2,682	2,934	361,003	2019/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	2,481	2,754	338,807	2020/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	2,075	2,330	286,643	2020/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	1,928	2,182	268,445	2042/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,374	2,068	254,458	2020/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,444	1,602	197,168	2021/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	2,333	2,631	323,667	2021/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,674	1,967	242,041	2021/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,415	1,601	197,048	2022/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	1,707	1,919	236,059	2022/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	2,222	2,483	305,496	2024/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,728	2,333	287,089	2022/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,644	1,816	223,488	2023/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,410	1,563	192,356	2023/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,817	2,019	248,448	2023/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	1,599	1,833	225,561	2024/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,561	1,768	217,555	2046/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,709	2,330	286,676	2024/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,594	1,778	218,773	2024/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	1,542	1,662	204,522	2025/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,394	2,479	305,025	2025/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	2,034	2,186	268,972	2026/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,168	2,222	273,352	2026/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,700	1,647	202,688	2017/12/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	733	739	90,904	2018/03/16	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	747	754	92,805	2018/06/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,500	1,518	186,729	2018/09/14	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	700	709	87,305	2018/12/14	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	500	508	62,489		

外国債券インデックスマザーファンド

2016年12月19日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,190	1,208	148,650	2018/02/23	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,392	1,411	173,625	2018/04/13	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	1,209	1,248	153,574	2018/10/12	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	1,438	1,494	183,852	2019/02/22	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,113	1,146	141,027	2019/04/12	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,151	1,184	145,680	2019/10/11	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,731	1,771	217,932	2020/04/17	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,448	1,497	184,186	2020/10/16	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,578	1,616	198,795	2021/04/09	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,700	1,739	213,932	2021/10/08	
国 小 計	銘 柄 数 金 額	51銘柄		79,796	94,777	11,658,637		
ユーロ（スペイン）	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.0000	1,832	2,686	330,504	2029/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.6000	1,745	1,797	221,070	2025/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.9500	1,552	1,561	192,095	2030/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	660	664	81,751	2018/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.1500	1,792	1,914	235,469	2025/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.1500	1,250	1,298	159,691	2020/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.9500	1,733	1,816	223,413	2026/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,172	1,182	145,416	2019/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	1,067	1,089	134,038	2021/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.9000	852	884	108,811	2046/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.4500	400	429	52,877	2066/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.3000	1,230	1,213	149,333	2026/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	1,979	2,966	364,955	2032/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2000	1,654	2,148	264,323	2037/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.9000	1,428	2,034	250,314	2040/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.1000	2,206	2,360	290,328	2018/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.8000	1,682	2,132	262,315	2024/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.6000	2,382	2,671	328,645	2019/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.3000	1,775	1,993	245,201	2019/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7000	1,173	1,631	200,663	2041/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	2,101	2,377	292,494	2020/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.6500	1,789	2,279	280,437	2025/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.8500	1,681	1,984	244,153	2020/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	2,515	3,088	379,860	2021/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.9000	1,665	2,333	287,012	2026/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.8500	1,978	2,520	310,037	2022/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	2,000	2,106	259,066	2018/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.4000	2,158	2,769	340,709	2023/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.4000	1,601	1,979	243,491	2023/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.1500	1,270	1,739	213,931	2028/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	1,564	1,681	206,812	2018/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.1500	1,049	1,559	191,803	2044/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,836	1,961	241,242	2019/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.8000	1,970	2,357	289,959	2024/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	2,097	2,351	289,244	2024/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4000	1,900	1,980	243,659	2020/01/31	
国 小 計	銘 柄 数 金 額	36銘柄		58,738	69,548	8,555,136		
ユーロ（イタリア）	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	9.0000	1,106	1,671	205,579	2023/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	7.2500	1,110	1,656	203,738	2026/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.5000	2,392	3,445	423,781	2027/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,814	1,945	239,362	2024/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	1,376	1,389	170,944	2018/01/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0500	1,445	1,484	182,623	2019/12/01	

2016年12月19日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,429	1,512	186,076	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.3500	1,229	1,260	154,999	2022/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,687	1,668	205,303	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.6500	1,465	1,359	167,221	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,258	1,264	155,588	2018/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7000	1,511	1,535	188,827	2020/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	1,591	1,624	199,771	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	1,504	1,546	190,237	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.3000	371	373	45,968	2018/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.6500	774	783	96,416	2020/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7000	1,140	1,081	133,048	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	1,259	1,248	153,616	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.6000	1,286	1,263	155,363	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.1000	812	813	100,125	2019/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.4500	1,674	1,667	205,138	2021/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	924	890	109,560	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,218	1,148	141,245	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.6500	700	673	82,855	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.3500	358	352	43,384	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.8000	448	393	48,406	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.0500	358	357	43,998	2019/10/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.2500	2,654	3,563	438,316	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	6.0000	2,849	4,144	509,835	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.7500	1,455	2,097	258,041	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.2500	2,074	2,263	278,405	2019/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	1,921	2,178	267,945	2020/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	2,098	2,840	349,446	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.0000	2,390	2,905	357,461	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.7500	2,734	3,127	384,717	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	2,480	2,609	320,952	2018/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	1,734	2,380	292,823	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500	2,101	2,585	318,010	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	2,187	2,351	289,245	2018/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	2,708	2,977	366,258	2019/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.2500	2,531	2,815	346,320	2019/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	2,118	2,675	329,058	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	1,893	2,588	318,351	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.2500	2,560	2,888	355,279	2020/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.0000	2,214	2,514	309,298	2020/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	2,070	2,538	312,202	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.7500	2,144	2,437	299,820	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500	2,281	2,716	334,152	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	2,012	2,440	300,232	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.5000	1,657	2,078	255,648	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.5000	1,910	2,395	294,696	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500	1,810	2,307	283,805	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	1,594	1,921	236,371	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.5000	1,770	1,863	229,271	2018/06/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500	1,363	1,826	224,719	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	2,194	2,665	327,871	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.5000	2,111	2,259	277,942	2018/12/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.7500	1,729	1,966	241,847	2021/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	2.5000	1,100	1,164	143,229	2019/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.7500	1,901	2,212	272,138	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.5000	1,938	2,223	273,551	2030/03/01

外国債券インデックスマザーファンド

2016年12月19日現在								
区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	2.1500	1,593	1,706	209,885	2021/12/15
			国 債 証 券	1.5000	1,246	1,292	158,982	2019/08/01
国 小 計	銘 柄 数 額 金	63銘柄			105,363	121,935	14,999,325	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.3750	432	445	54,840	2020/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.7500	414	407	50,111	2031/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.8750	279	291	35,826	2025/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.5000	411	412	50,704	2026/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	-	200	199	24,501	2023/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	4.3750	416	469	57,804	2019/07/04	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	4.0000	667	877	107,883	2025/07/04	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	3.3750	632	715	87,973	2020/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	3.5000	459	537	66,063	2021/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.7500	389	481	59,185	2028/07/04	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	1.6250	612	676	83,168	2022/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	1.5000	446	489	60,210	2023/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.6250	407	539	66,393	2042/07/04	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	1.1250	425	438	53,943	2018/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.0000	529	601	73,964	2024/04/15	
国 小 計	銘 柄 数 額 金	15銘柄			6,718	7,581	932,574	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.2500	527	539	66,336	2019/10/18	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.2000	873	935	115,059	2025/10/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.7500	576	586	72,097	2026/10/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.5000	234	238	29,331	2047/02/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	-	300	299	36,846	2023/07/15	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	6.2500	985	1,567	192,775	2027/07/15	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.6500	1,066	1,127	138,647	2018/01/15	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.9000	1,248	1,444	177,656	2020/07/15	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.5000	1,337	1,581	194,523	2021/09/15	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.1500	1,073	1,660	204,235	2037/03/15	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.3500	989	1,099	135,242	2019/03/15	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.8500	675	948	116,664	2026/03/15	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.6500	797	962	118,369	2022/04/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.4000	872	1,054	129,745	2022/11/22	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.8000	318	554	68,162	2062/01/26	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.9500	738	785	96,649	2019/06/18	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.1500	623	883	108,649	2044/06/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.7500	959	1,074	132,234	2023/10/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	2.4000	501	610	75,056	2034/05/23	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.1500	426	440	54,161	2018/10/19	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.6500	932	1,036	127,552	2024/10/21	
国 小 計	銘 柄 数 額 金	21銘柄			16,049	19,429	2,389,999	
通貨小計	銘 柄 数 額 金	288銘柄			432,060	510,766	62,829,400	
合 計	銘 柄 数 額 金	746銘柄					157,499,588	

(注 1) 邦貨換算金額は、2016年12月19日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注 2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第28期（決算日 2016年9月20日）

（計算期間 2015年9月25日～2016年9月20日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

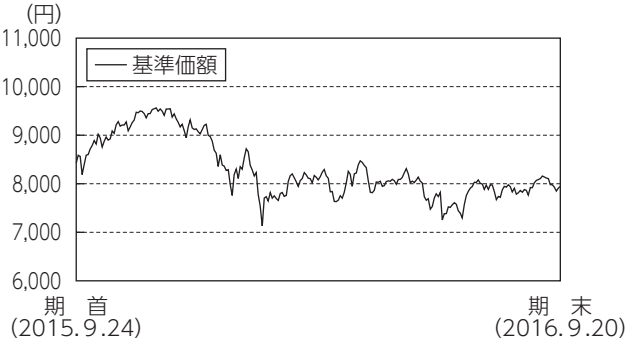
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額 円	T O P I X (ベンチマーク)		株 式 組 入 比 率		株 式 先 物 比 率
		騰 落 率 %	騰 落 率 %	組 入 比 率 %	組 入 比 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おります。

◆ポートフォリオについて

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

株式ポートフォリオは、最適化の手法（株価変動を数理的にいくつかの要因に分解し、それに基づいて、ポートフォリオがT O P I Xと同じように変動するよう、銘柄、株数を決定する体系的な手法）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、ベンチマークとかが離れました。

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	0円 (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 株数	当期末 株数	期末 評価額 千円	銘柄	期首 株数	当期末 株数	期末 評価額 千円	銘柄	期首 株数	当期末 株数	期末 評価額 千円
水産・農林業 (0.1%)				ユアテック	12	12	6,360	ハウス食品G本社	23.1	21.9	49,187
極洋	37	35	9,485	中電工	9.7	7.5	14,865	カゴメ	21	23.1	57,495
日本水産	86.2	77.9	34,509	関電工	29	26	23,842	アリアケジャパン	6.1	5.6	29,400
マルハニチロ	15.3	14	34,692	ぎんでん	40.7	35.1	39,768	ニチレイ	71	71	75,331
サカタのタネ	11	10.7	27,552	東京エネシス	6	8	7,624	東洋水産	32.6	31.5	136,552
ホクト	7.5	7	12,558	トーエネック	12	11	5,225	日清食品HD	26.5	27.2	165,376
鉱業 (0.3%)				住友電設	6.1	6	6,210	永谷園ホールディングス	8	8	10,080
日鉄鉱業	23	20	7,760	日本電設工業	10.6	9.9	17,641	一正蒲鉾	0.4	—	—
三井松島	66	57	6,840	協和エクスオ	26.7	25.3	36,583	フジッコ	7	6.9	14,959
国際石油開発帝石	333.5	338.9	280,168	九電工	12	12.2	41,236	ロックフィールド	4.2	8.4	11,944
日本海洋掘削	2.2	2.5	5,552	三機工業	13.9	14.3	11,954	日本たばこ産業	375.6	361.7	1,434,502
石油資源開発	9.1	10.2	21,205	日揮	64	65	109,785	わらべや日洋HD	4.4	4.1	8,122
K&Oエナジーグループ	5.2	5.1	7,007	中外炬工業	28	34	6,766	ユーグレナ	21	22.5	32,625
建設業 (3.1%)				太平電業	10	10	9,590	ミヨシ油脂	48	95	11,875
ショーボンドHD	6	6.8	31,042	高砂熱学	17.7	18.6	27,583	繊維製品 (0.8%)			
ミライト・ホールディングス	20.7	20.4	17,748	明星工業	14	13.9	6,463	グンゼ	9.2	8.9	10,306
安藤・間	44.4	44.7	27,267	大気社	9.5	7.4	18,352	クニタ	50	49	15,337
東急建設	23.9	22	21,538	ダイダ	11	10	7,830	東洋紡	253	244	40,016
コムシスホールディングス	28.5	27.1	49,836	日比谷総合設備	9	8.6	14,052	ユニチカ	235	233	13,048
東急建設	9.5	8.9	6,764	東芝プラントシステム	10.1	9.9	15,780	富士紡ホールディングス	36	37	10,508
高松コンストラクションGP	5.3	4.8	11,092	東洋エンジニア	33	35	10,885	日清紡ホールディングス	40	—	—
東建コーポレーション	2.7	2.8	20,888	千代田化工建	46	47	37,506	倉敷紡績	72	58	10,556
大成建設	328	340	258,400	新興プランテック	14.4	13.5	9,517	シキボウ	69	121	13,068
大林組	190	196	193,256	食品 (4.9%)				日本毛織	20	18.6	12,982
清水建設	193	199	177,110	日本製粉	39	43	32,379	ダイドーリミテッド	15.6	14.7	6,012
飛鳥建設	46.7	62	10,726	日清製粉G本社	70	71	107,352	帝国繊維	7.3	7	9,660
長谷工コーポレーション	79.8	76.8	71,961	昭和産業	30	27	13,986	帝人	246	248	97,712
松井建設	11	10.3	11,433	中部飼料	4.8	8.5	6,069	東レ	456	439	422,625
銭高組	7	18	6,246	フィード・ワン	61.9	54.7	6,235	サカイ オーベックス	—	58	11,136
鹿島建設	277	306	213,588	日本甜菜糖	49	49	9,408	住江織物	24	37	8,251
不動産トラ	52.8	51.3	8,669	三井製糖	29	28	13,020	日本バイリー	13	—	—
鉄建建設	42	43	13,416	森永製菓	62	61	54,717	芦森工業	90	89	7,050
西松建設	70	75	34,350	中村屋	23	23	10,373	アツギ	17	16.1	9,434
三井住友建設	264	255.1	24,744	江崎グリコ	14.7	15.1	82,899	セーレン	17	13.2	18,756
大豊建設	19	27	14,553	不二家	43	51	10,200	小松精練	15.7	13.2	8,448
前田建設	43	40	33,360	山崎製パン	46	48.4	119,257	ワコールホールディングス	34	33	36,399
ナカノフード建設	3.5	15.2	5,973	第一屋製パン	—	44	5,500	ホギメディカル	3.8	3.8	27,398
奥村組	60	58	32,422	モロゾフ	24	21	9,051	T S Iホールディングス	28.2	27.6	15,538
東鉄工業	8.1	8	22,392	亀田製菓	3.8	3.9	20,436	三陽商会	39	37	5,883
浅沼組	17	37	7,992	寿スピリッツ	2.2	5.7	13,149	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	カルビー	23.4	24.1	91,459	ゴールドウイン	16	2.8	14,700
熊谷組	83	97	25,608	森永乳業	60	59	44,368	デサント	14.9	14.4	17,668
北野建設	20	33	8,415	六甲バター	1.7	4	11,488	パルプ・紙 (0.3%)			
三井ホーム	16	13	5,954	ヤクルト	33.9	35.3	167,498	特種東海製紙	40	38	12,692
矢作建設	10.7	10.1	9,059	明治ホールディングス	18.7	39.4	376,664	王子ホールディングス	243	229	92,516
ピーエス三菱	—	20.3	7,064	雪印メグミルク	15.4	15.7	54,243	日本製紙	29.4	31.2	57,876
日本ハウスHLDGS	14.1	27.2	10,390	プリマハム	41	46	16,376	三菱製紙	121	111	7,548
大東建託	23.3	24.4	390,278	日本ハム	47	47	113,975	北越紀州製紙	40.6	39.5	24,608
新日本建設	4.7	10.7	9,416	伊藤ハム	36	—	—	中越パルプ	28	30	6,750
N I P P O	14	15	28,605	丸大食品	37	36	17,280	大王製紙	27	27.2	32,504
東亜道路	16	27	6,831	米久	1.4	—	—	レンゴー	52	53	33,125
前田道路	20	19	34,276	S Foods	4.9	4.6	12,084	トーモク	27	24	6,600
日本道路	21	20	7,860	伊藤ハム米久HLDGS	—	41.9	42,360	ザ・バック	4.9	4.7	12,064
東亜建設	53	61	10,797	サッポロホールディングス	108	20.2	55,388	化学 (6.4%)			
若築建設	44	92	13,248	アサヒグループホールディングス	118.9	122.7	436,443	クラレ	92.4	94.8	134,900
東洋建設	20.6	22.4	9,497	キリンHD	256.4	281	457,889	旭化成	369	378	302,173
五洋建設	72.4	73.1	39,766	宝ホールディングス	51.9	47.3	44,083	共和レザー	—	6.3	4,794
大林道路	9	9.1	5,651	オノンホールディングス	35	60	13,200	昭和電工	40	40.8	51,122
世紀東急	12.3	13.3	6,809	コカ・コーラウエスト	21.1	22.1	55,338	住友化学	435	445	203,810
福田組	11	12	12,468	コカ・コーラフーズジャパン	22.1	23.2	45,286	住友精化	14	14	9,506
住友林業	47	44.6	59,808	サントリー食品インター	42.8	45.5	192,010	日産化学	39	36.7	113,586
日本基礎技術	5.2	26.2	8,515	ダイドードリンク	3.2	3.4	18,564	ラサ工業	—	41	4,264
日成ビルド工業	24	22	10,208	伊藤園	18.4	19.3	65,330	クレハ	43	45	16,515
ヤマダ・エスバイエルホーム	52	—	—	キーコーヒー	6.4	6.7	12,750	テイカ	15	14	7,182
バコーポレーション	14.7	—	—	日清オイログループ	35	36	16,488	石原産業	113	120	7,920
パナホーム	25	25	19,600	不二製油グループ	17.1	17.5	34,790	日東エフシー	—	5.8	4,645
大和ハウス	186.9	193	513,283	Jーオイルミルズ	33	32	11,296	日本曹達	41	41	17,302
ライト工業	11.2	13.4	15,624	キッコーマン	52	49	156,800	東ソー	156	164	100,860
積水ハウス	199	217.3	363,434	味の素	146	138.1	307,134	トクヤマ	101	110	38,060
日特建設	11.2	18.6	8,872	キユーピー	32	33.9	102,039	セントラル硝子	63	66	26,004
								東亜合成	35.8	37.2	39,097

銘柄	期首株数	当期末株数	期首評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期首評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期首評価額
大阪ソーダ	千株 29	千株 28	千円 11,032	星光PMC	千株 2.1	千株 5.6	千円 6,406	出光興産	千株 28.1	千株 31.2	千円 61,869
関東電化	16	16	13,744	小林製薬	9.6	18.2	93,548	J Xホールディングス	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	コスモエネルギーHDGS	—	18.6	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	横浜ゴム	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	デクセリアルズ	12.1	17.8	15,806	藤倉ゴム	6.7	—	—
日本パーカライジング	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	日本農薬	14.1	15.1	7,504	パンドー化学	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
カネカ	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
J S R	56.8	56.8	88,835	エフビコ	5.4	5.3	28,408	住友大阪セメント	115	123	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HDGS	369	403.1	244,520	信越ポリマー	14.7	14.3	9,466	日本ヒューム	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
住友バークライト	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	日本碍子	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	MA R UWA	2	2.8	10,276
日立化成	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	フジミコン・ボレーテッド	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
ダイキョーニシカワ	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	J F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	参大製薬	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	共栄製鋼	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	9,225	JICRFアーマ	5.2	5.4	13,597	日本高周波	—	64	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
DIC	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	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
富士フイルムHDGS	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	日本コークス工業	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
エシ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
エステ	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

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
住友電工	千株	千株	千円	クボタ	千株	千株	千円	富士電機	千株	千株	千円
フジクラ	222.7	241.1	347,063	三菱化工機	284	293.8	430,710	東洋電機製造	156	175	79,800
昭和電線HLDGS	86	84	46,872	月島機械	24	34	7,208	安川電機	16	38	11,780
タツタ電線	85	98	6,664	帝国電機製作所	11.8	11.8	12,413	シフオニア テクノロジー	69.7	72.2	107,794
リョービ	12.6	16.7	5,794	新東工業	5.5	8	6,328	明電舎	46	47	7,802
アールステイ	39	39	16,965	渋谷工業	15.5	14.6	12,074	山洋電気	59	56	18,424
アサヒHD	7.5	9.4	9,672	アイチ コーポレーション	5.5	5.5	9,955	デンコ	14	17	9,265
金属製品 (0.6%)	9.6	9.4	16,384	小森コーポレーション	11.6	10	7,090	東芝テック	5.7	6.2	6,175
稲葉製作所	1.5	4.5	5,530	鶴見製作所	15.3	15.2	19,273	マブチモーター	42	43	17,028
宮地エンジニアリング	11	56	7,952	住友精密	5.3	5.1	7,507	日本電産	16.1	16.6	87,814
トーカロ	4.6	5.3	11,803	荏原製作所	14	21	6,552	東光高岳	62.5	70.8	633,447
SUMCO	45.7	48.8	40,162	西島製作所	124	135	74,790	ダブル・スコープ	3	3.4	6,732
川田テクノロジー	42.3	41.1	75,624	北越工業	7.7	7.7	7,915	ダイヘン	—	5.6	11,922
東洋製罐グループHD	1.5	1.5	6,675	ダイキン工業	5.9	14.3	9,295	JVCケンウッド	33	35	18,480
ホッカンホールディングス	24	20	6,860	オルガノ	82.4	85	796,280	田淵電機	45.5	47.7	11,829
横河ブリッジHLDGS	12.3	12.4	13,416	トーヨーカネツ	15	14	5,670	ミマキエンジニアリング	2	—	—
三和ホールディングス	57.1	61.4	58,084	栗田工業	42	42	8,526	第一精工	2.5	3.8	3,689
文化シャッター	19	18.2	13,650	日本コンベヤ	32.3	35.2	80,537	日新電機	15	14.6	23,827
三協立山	8.4	8.3	13,097	アネスト岩田	31	34	26,146	大崎電気	11	12	11,700
アルインコ	—	6.8	6,120	ダイフク	12.2	11.6	11,565	オムロン	60.4	65.7	237,834
LEXILEグループ	87.1	83.2	180,211	加藤製作所	28.8	31.2	54,350	日東工業	9.3	9.6	12,873
ノーリツ	11.8	11.8	24,083	油研工業	—	21	8,610	I D E C	8.5	9.3	8,593
長府製作所	6.5	5.9	15,198	タダノ	14	54	9,072	シーエス・ユアサ コーポ	113	114	47,196
リンナイ	10.9	11.2	102,256	フジテック	17.2	17	19,329	サクサホールディングス	9	—	—
岡部	13.2	13.7	11,343	CKD	16.8	17.3	20,344	メルコホールディングス	4	4.2	10,802
ジーテクト	4	7.3	13,329	キトー	7.8	9.3	8,332	日本電気	729	797	204,829
東プレ	12.4	12.2	24,766	平和	18.5	18	41,202	富士通	544	560	300,272
高周波熱錬	12.4	12.8	9,241	理想科学工業	7.5	6.7	10,867	沖電気	209	260	35,880
東京製鋼	50	49	7,938	SANKYO	15.5	15.3	53,091	電気興業	20	19	9,443
パイオラックス	3.4	3.3	19,833	日本金銭機械	6.1	6.7	9,279	サンケン電気	31	36	11,412
日本発条	51.5	53.3	51,381	福島工業	4.7	3.9	7,683	アイホン	4.4	4.1	6,535
三益半導体	6.5	5.5	6,319	ダイコク電機	3.9	4.2	13,398	ルネサスエレクトロニクス	28.9	33	20,427
機械 (5.0%)	86	102	47,532	竹内製作所	3.5	3.4	5,168	セイコーエプソン	76.5	86.2	163,780
日本製鋼所	25.5	27.2	54,073	アマノ	19.8	18	28,404	ワコム	48	48.4	15,052
三浦工業	20	23	21,045	JUKI	9.4	10.4	7,280	アルバック	9.9	10.9	31,588
タクマ	19	20	10,460	サンデンホールディングス	38	37	10,767	アクセル	4.5	4.9	3,547
ツガミ	40	40	30,240	蛇の目ミシン	67	12	6,552	E I Z O	5.7	6.1	16,012
オーコム	35	34	11,254	マックス	10	10	11,540	ジャパンディスプレイ	114.7	110.1	18,276
東芝機械	89	85.8	91,634	グローリー	18.1	19.7	64,616	日本信号	16.1	16.6	13,612
アマダホールディングス	14.3	16.9	13,148	新晃工業	5.3	5.3	6,799	京三製作所	17	19	7,011
アイダエンジニア	29	81	10,692	大和冷機工業	9.9	10.8	9,622	能美防災	8	7.1	10,224
滝澤鉄工所	20.2	17.9	20,495	セガミホールディングス	60.8	60.9	86,782	ホーチキ	2.6	5.6	5,964
富士機械製造	31	31	19,158	日本ビストンリシング	34	7.5	11,227	エレコム	2.5	5.9	12,443
牧野フライス	27.3	27.4	52,799	リケン	30	31	10,416	日本無線	16	21	5,649
オーエスジー	17.3	17.2	14,035	T P R	7	7.5	20,655	パナソニック	693.6	666.3	678,293
旭ダイヤモンド	38.3	33.9	34,510	ホシザキ	12.3	12.9	112,746	シャープ	479	—	—
DMG森精機	10.4	15.3	11,061	大豊工業	6.6	6	6,708	アンリツ	34	34.6	19,583
ソディック	7.1	7.7	91,630	日本精工	117.1	118.7	124,397	富士通ゼネラル	18	18	36,954
ディスコ	4.1	4.1	9,290	NTN	134	145	51,765	日立国際電気	16	14	25,494
OKK	—	42	4,158	ジェイテクト	60.6	59.8	88,563	ソーニ	397.6	412.5	1,369,500
島精機製作所	9.1	8.8	22,290	不二越	54	54	19,170	T D K	34.1	34.9	251,629
NCホールディングス	—	3.2	2,672	日本トムソン	22	22	8,250	帝国通信工業	—	46	6,854
日阪製作所	9.4	9.4	7,444	T H K	37.4	37.9	72,957	ミツミ電機	22	24.9	14,367
やまびこ	2.7	12.1	9,934	ユーシン精機	3.2	3.1	7,272	タムラ製作所	26	27	10,098
ナブテスコ	36.1	31.2	86,486	イーグル工業	8.8	7.7	9,871	アルプス電気	46	50.7	124,975
三井海洋開発	6.1	7.4	12,143	日本ビラー工業	8.5	7.5	7,005	パイオニア	92.4	97.4	21,622
S M C	17.7	18.2	520,338	キッツ	27.3	29.2	16,030	日本電波工業	7.7	8.1	6,650
新川	4.4	11.5	7,348	日立工機	15.4	7.2	5,133	日本トリム	1.1	1.9	10,944
ソコカワミクロン	14	12	6,828	マキタ	36.7	37.5	267,000	ローランド ディー・ジー	2.8	3.6	8,154
ユニオンツール	3.1	2.9	7,571	日立造船	48.7	46.7	24,003	フオスター電機	6.4	7.7	14,753
オイレス工業	7.5	7.7	12,681	三菱重工業	948	1,032	448,300	クラリオン	34	34	10,234
日精エースビー	2.6	2.8	4,494	I H I	407	446	126,218	S M K	20	22	7,370
サトーホールディングス	7.8	8.4	18,001	電気機器 (12.3%)	—	30.2	30,864	ヨコオ	—	8.1	4,900
日精樹脂工業	5.5	7.2	4,845	日清紡ホールディングス	—	36.1	47,471	東光	19	—	—
小松製作所	290.2	299.1	684,490	コニカミノルタ	132.2	144.5	125,137	ホシデン	18.7	19.6	14,974
住友重機械	163	176	88,704	ブラザー工業	72.4	73.9	126,812	ヒロセ電機	9.5	9.2	119,324
日立建機	26.9	26.7	52,839	ミネベア	85	94	89,018	日本航空電子	17	17	26,656
巴工業	3.8	3.8	5,779	日立	1,358	1,482	701,578	T O A	7.4	7.9	7,102
井関農機	65	66	16,302	東芝	1,189	1,240	391,840	日立マクセル	10.1	9.8	15,346
T O W A	3.2	8	9,536	三菱電機	566	619	775,916	古野電気	9	10.1	5,423
丸山製作所	—	27	4,509					ユニデンホールディングス	26	94	14,194
北川鉄工所	33	47	7,802					アルパイン	14.2	14.4	17,049
								スミダコーポレーション	8.2	—	—

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

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
近鉄グループHLDGS	千株	千株	千円	LINE	千株	千株	千円	マクニカ・富士エレクトロニクス	千株	千株	千円
阪急阪神HLDGS	562	577	242,340	野村総合研究所	—	9.5	41,895	バイタルKSKHD	10.8	10.9	12,088
南海電鉄	373	77.4	265,869	インテジホールディングス	31.5	40.5	140,535	UKCホールディングス	12.7	11.1	11,266
京阪ホールディングス	129	130	63,830	フジ・メディア・HD	4.5	4.3	6,888	TOKAIホールディングス	4.6	4.3	7,030
神戸電鉄	128	128	90,624	オービック	58.2	58.7	77,894	三洋貿易	30.1	29.3	19,338
名古屋鉄道	28	27	9,990	ジャストシステム	19.3	19.9	103,679	シブサヘルスケアHD	5.5	5.3	6,444
山陽電鉄	194	209	111,188	ヤフー	10.2	12.9	11,055	小野建	10.6	11.8	34,833
日本通運	25	27	14,310	トレンドマイクロ	400.4	424.3	173,538	佐島電機	6.6	6.5	7,839
ヤマトホールディングス	219	221	111,384	日本オラクル	27.6	28.1	99,333	ナガイレバン	—	14.2	9,684
山九	99.4	106	257,845	フューチャー	8.8	9.6	57,984	三菱食品	8.6	9.3	19,213
丸全昭和運輸	69	76	43,548	CAC HOLDINGS	9.8	10.2	7,425	松田産業	5.9	6.4	19,392
センコー	24	24	8,760	オービックビジネスEC	6.6	9.7	7,924	第一興商	5.6	5.9	7,675
トナミホールディングス	26	27	18,387	伊藤忠テクノソリューションズ	4	3.2	14,896	メディカルHD	—	10.2	40,392
ニッコンホールディングス	7	16	4,128	アイティフォー	13.2	13.3	34,486	アズワン	55.6	56.5	97,180
福山通運	18.4	17.6	38,227	大塚商会	14.8	24	13,896	シモジマ	4.6	4.8	20,424
セイノーホールディングス	32	34	20,468	サイボウズ	15.1	15.8	75,919	ドウシシャ	6.5	6.3	6,356
神奈川中央交通	43.7	40	43,840	電通国際情報S	—	27.5	13,282	黒田電気	7.9	7.4	15,569
日立物流	17	13	9,191	ウェザーニューズ	5.8	4.5	8,433	ハビネット	10.1	11.2	21,772
丸和運輸機関	11.9	12.6	26,182	C I J	2.5	2.5	7,675	エクセル	3	11.8	6,690
海運業 (0.2%)	0.3	—	—	WOWOW	—	14.1	6,387	I DOM	4.4	6.5	6,682
日本郵船	479	507	94,302	フュージョンパートナー	3.3	3.5	9,737	進和	2	4.2	5,031
商船三井	298	283	65,939	イマジカ・ロボットHD	1.6	—	—	シークス	18.1	16.6	9,412
川崎汽船	255	257	65,792	ネットワンシステムズ	2.9	—	—	伊藤忠	—	4.9	6,992
NSユニテッド海運	30	34	4,658	マーベラス	25.1	26.6	18,779	丸紅	4.1	4	16,020
飯野海運	34.3	34.9	12,773	エイベックス・グループHD	10.6	11.6	8,758	長瀬産業	465.3	452.9	560,690
空運業 (0.6%)	—	—	—	日本ユニシス	11.5	11.2	15,489	堀理	484.1	559.5	284,785
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	17.7	16.8	21,386	高島	—	66	10,626
倉庫・運輸関連業 (0.2%)	1,112	1,072	304,448	東京放送HD	6.6	5.2	9,729	豊田通商	30.7	26	31,616
トランコム	1.9	2	11,680	日本テレビHD	34.4	33.7	49,471	三共生興	5	4.7	6,669
日新	31	29	8,497	朝日放送	51.2	51.9	85,790	兼松	62.3	62.1	147,363
三菱倉庫	38	39	59,397	テレビ朝日HD	1.4	—	—	三井物産	17.4	13.2	4,224
三井倉庫HOLD	38	39	59,397	スカパーJ SATHD	16	16	28,784	日本紙パルプ	121	129	19,479
住友倉庫	41	39	11,583	テレビ東京HD	48.9	46.7	22,135	日立ハイテクノロジーズ	470.2	520.7	699,560
住友倉庫	43	35	18,340	コネクト	5.5	6.2	13,410	カメイ	19	28	9,212
洗沢倉庫	21	22	6,138	日本通信	6.7	6.7	9,011	東都水産	19.4	19.5	74,490
東陽倉庫	21	22	6,138	KDDI	25.6	46	8,234	スターゼン	9.6	8.5	6,927
日本トランスシティ	26	25	5,750	光通信	437.5	444	2,048,616	山善	—	28	4,508
安田倉庫	20	18	6,372	NTTドコモ	568	569.3	1,746,043	住友商事	30	2.5	11,975
東洋埠頭	7.3	7.1	4,189	エムティーアイ	5	6.8	62,220	第一実業	23.3	23.4	17,994
上組	31	29	12,324	GMOインターネット	431.2	429.5	1,099,090	西華産業	325.1	355.2	395,692
キユーソー流通システム	65	64	56,896	学研ホールディングス	5.5	10.6	6,646	菱洋エレクトロ	20	19	8,075
郵船ロジスティクス	0.9	2.9	6,594	ゼンリン	19.9	22.2	29,015	ユアサ商事	426.9	431.9	917,355
近鉄エクスプレス	6.2	6.7	6,586	松竹	14.3	18.3	25,107	神鋼商事	19	18	9,270
情報・通信業 (8.4%)	5.2	11.1	14,407	NTTデータ	32	28	8,456	阪和興業	15.8	16.3	29,454
NECネットエスアイ	7.3	7	12,159	DT S	9.7	8.4	14,439	カナデ	26	29	7,627
システム	9.7	7.4	13,112	スクウェア・エニックス・HD	39	38	43,890	菱電商事	7.9	7.7	9,216
デジタルアーツ	2.3	4.2	10,718	シーイーシー	40.9	40.9	135,788	ユアサ商事	5.7	6.1	13,212
新日鉄住金SOL	5.2	10.2	17,890	カブコン	23	22	17,622	神鋼商事	30	54	9,558
TIS	—	19.4	48,150	ジャステック	34.7	36.4	189,644	伊藤忠エクス	59	59	35,046
ITホールディングス	19.2	—	—	S C S K	6.9	7.2	15,940	阪和興業	10.8	10.1	9,625
電算システム	—	3.4	5,035	アイネス	22	24.4	78,324	カナデ	14	13	8,762
グリー	34.9	36.3	22,360	T K C	6.2	5.9	11,003	菱電商事	60	67	38,994
コーエーテックモHD	13.9	14	26,236	富士ソフト	8.7	10.7	10,946	すてきナイスグループ	37	36	4,968
三菱総合研究所	3.3	2.9	9,309	N S D	13.8	14.2	55,664	昭光通商	44	—	—
ファインテックス	3.2	—	—	J B C Cホールディングス	9.7	10.1	11,524	三菱石油	17	15	9,615
K L a b	8.1	11	6,688	ミロク情報サービス	5.9	5.8	17,179	稲畑産業	15.4	15.2	14,835
ポルトウイン・ピットル	3.2	9.1	7,562	ソフトバンクグループ	8.7	9	24,723	ワキタ	13.5	12.8	9,587
ネクソン	54.2	56.1	83,252	J A L U X	13.2	13.1	20,684	東邦ホールディングス	19.6	18.7	39,681
アイスタイル	1.8	11	8,404	あらた	15.7	26.1	99,832	サンゲツ	19.6	20	37,100
イチチーム	1.7	4.4	9,605	フィールズ	10.4	10	6,640	ミツウロコグループ	14.2	10.9	5,831
en i s h	0.9	—	—	双日	—	6.6	11,431	シノンホールディングス	19	16	6,304
コプロラ	14.9	16.4	24,714	あいホールディングス	295.6	327	21,177,979	伊藤忠エクス	14.5	15.2	11,901
オールドプラス	1.1	—	—	ダイワボウHD	—	3	5,001	サンリオ	15.7	17.5	32,847
ブロードリーフ	5.3	7.8	8,572	J A L U X	—	3	5,001	サンワ テクノス	5.6	5.9	4,200
ハーツユニテッドグループ	1.3	—	—	あらた	4.1	3	6,813	リョーサン	9.9	9.1	28,346
ブイキューブ	1	—	—	フィールズ	2.3	4.7	5,978	新光商事	8.6	7.7	7,869
ティーガイア	6.6	6.2	8,785	双日	388.8	366.7	92,775	トーホー	4.6	3.6	8,254
豆蔵ホールディングス	3.1	—	—	アルフレッサホールディングス	65.5	71.4	151,153	三信電気	9.4	9.6	8,448
ガバ・オンライン・エンター	—	133.3	32,125	横浜冷凍	17.5	15.7	15,700	東陽テクニカ	10.3	10.4	10,452
GMOペイメントゲートウェイ	5.4	5.2	24,830	アルコニックス	4.4	5.3	7,186	モスフード サービス	7.3	7.7	24,293
インターネットインアジア	9.9	9.9	18,572	神戸物産	2	4.3	9,558	加賀電子	6.1	6	7,206
S R Aホールディングス	2.1	4.3	9,240	あいホールディングス	9.8	10.8	24,915	P A L T A C	9.7	9.4	21,902
朝日ネット	14.3	15	6,465	ダイワボウHD	67	58	13,514	三谷産業	3.2	—	—
g u m i	4.4	8.1	6,212	卸売業 (4.2%)	—	—	—	ヤマタネ	49	77	10,164

銘柄	期首株数	当期末株数	当期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	当期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	当期末評価額
日鉄住金物産	千株 34	千株 47	千円 16,826	サイゼリヤ	千株 8.9	千株 9.8	千円 22,383	三井住友トラストHD	千株 1,237	千株 1,195	千円 409,287
トラスコ中山	6.9	6.9	35,742	V Tホールディングス	14.7	21.7	9,699	三井住友フィナンシャルG	422.8	461.2	1,585,144
オートバックスセブン	19.8	21.5	31,820	ユナイテッドアローズ	7.4	8.3	20,351	第四銀行	70	66	26,202
加藤産業	8.5	8.2	18,163	ハイデイ日高	4.9	5.6	12,829	北越銀行	68	64	14,272
イノテック	—	19.1	9,416	京都きもの友禅	8.1	8.5	7,539	西日本シティ銀行	194	178	36,668
イエローハット	5.9	5.8	11,663	コロナフイ	20	19.3	36,477	千葉銀行	216	218	128,402
日伝	2.6	2.9	8,244	香番屋	2.8	5.4	17,604	横浜銀行	375	—	—
因幡電機産業	8.3	6.8	23,698	スキホールディングス	9.9	10.2	54,264	常陽銀行	197	198	93,456
ミスミグループ本社	63.3	64	114,624	スクロール	—	19.8	7,385	群馬銀行	128	122	57,462
スズケン	25.3	25.8	83,592	ヨンドシーホールディングス	4.9	4.8	10,790	武蔵野銀行	9	8.9	24,172
ジェコ	4.9	4.9	4,125	ユニ・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%)				木曽路	6.9	7.9	17,925	筑波銀行	27.7	27.4	8,192
ローソン	20.7	22	172,260	サトレストラジシステムズ	—	10.4	8,663	七十七銀行	92	87	36,279
サンエー	4.5	4	19,360	千趣会	12.9	14.2	9,443	青森銀行	50	43	13,330
カワチ薬品	5.3	4.9	11,686	ケーヨー	14.7	13.2	6,679	秋田銀行	43	40	12,280
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	島忠	14	14.6	35,127	みちのく銀行	32	30	6,090
くらこコーポレーション	3.8	3.6	16,884	デコダ	6.9	6.8	16,401	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
パルグループHLDGS	3.7	3.7	8,558	リンガーハット	6.3	5.8	13,258	十六銀行	71	69	20,286
エディオン	27.6	24.8	21,377	AOKIホールディングス	13.6	13.4	15,356	スルガ銀行	57.7	56.6	139,405
あみやき亭	1.4	1.5	5,490	オークワ	10	10	9,370	八十二銀行	99	97	50,925
ひらまつ	11	12.6	7,320	コメリ	9.8	8.7	20,610	山梨中央銀行	37	34	14,280
ゲンキョー	0.9	1.7	6,196	青山商事	14.1	10.9	37,877	大垣共立銀行	72	75	26,175
ハニーズ	6	6.7	8,227	しまむら	6.4	6.7	79,194	福井銀行	51	51	13,209
アルペン	5.3	5.5	10,081	高島屋	82	84	68,796	北國銀行	60	59	18,408
クオール	6.8	6.8	9,533	松屋	12	12.5	9,000	清水銀行	2.6	2.7	7,360
ジェイアイエヌ	4.1	4.1	18,163	イチ・ツチ・オーリテイリング	26.9	29.2	42,427	滋賀銀行	53	49	24,451
ビックカメラ	26.9	32.6	27,416	近鉄百貨店	21	27	9,126	南都銀行	49	52	19,084
DCMホールディングス	28.6	28	24,024	ニッセンHD	17.9	—	—	百五銀行	55	50	18,900
Monotaro	10.1	21	55,650	パルコ	8.2	6.6	6,408	京都銀行	105	107	80,143
アークランドサービスHD	0.6	2.6	7,904	丸井グループ	60	70.6	99,616	紀陽銀行	21.9	21.7	34,155
J. フロント リテイリング	71.2	72.4	92,382	AKSリアル リテイリング	5	4.8	15,480	三重銀行	39	28	5,796
ドトール・日レスHD	10.3	10.2	19,033	イオン	229.6	238.5	355,365	ほくほくフィナンシャルG	365	370	52,170
マツモトキヨシHLDGS	12.7	11.9	60,095	ユニークグループ・HD	57.8	—	—	広島銀行	160	165	68,970
ブロンコビリー	1.6	3.3	9,810	イズミ	12.7	11.2	47,712	山陰合同銀行	35	34	23,800
スタートトゥデイ	17.7	18	89,550	東武ストア	18	1.7	4,722	中国銀行	37.4	37.8	46,645
トレジャー・ファクトリー	0.6	—	—	平和堂	12.1	11.7	24,078	鳥取銀行	—	34	5,712
物語コーポレーション	1.8	1.9	8,483	フジ	7	6.8	13,219	伊予銀行	58.3	55.8	35,265
ココカラファイン	6.2	6.1	23,088	ヤオコー	6.7	6.6	26,664	百十四銀行	62	60	18,480
三越伊勢丹HD	111.3	113.5	116,905	ゼビオホールディングス	7.9	8	12,488	四国銀行	50	46	10,028
ウエルシアHD	5.3	5.1	33,915	ケーズホールディングス	13	23.8	40,483	阿波銀行	43	44	28,116
クリエイトSDH	2.9	8.9	20,407	アインホールディングス	7.1	7.1	44,588	鹿児島銀行	38	—	—
チムニー	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
ヤマ王	0.3	—	—	ミニストップ	5.3	4.9	8,584	みずほフィナンシャルG	7,840.3	8,180.9	1,425,112
クリエイト・レストランズ・ホール	4.7	16.8	17,136	アークス	9.9	10.7	26,215	高知銀行	—	107	11,556
ツルハホールディングス	11.9	13.5	145,125	パローホールディングス	12.8	12.4	35,290	山口フィナンシャルG	54	51	54,468
サンマルクホールディングス	4.6	4.8	13,190	ベルク	3.2	3.1	11,470	長野銀行	—	33	6,468
トリドール	6.8	7.3	16,563	ファーストリテイリング	11.2	9.7	315,347	名古屋銀行	52	48	16,896
クスリのアオキ	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	ペルレーナ	17.1	15.9	9,762	第三銀行	45	39	6,825
カップ・クリエイト	9.9	9.4	11,703	銀行業 (7.7%)				中京銀行	—	27	6,453
ライトオン	—	5.7	6,857	じもとホールディングス	47.1	51.6	7,224	東日本銀行	30	—	—
良品計画	6.9	6.7	128,908	足利ホールディングス	33.8	42.2	16,922	大光銀行	34	28	6,076
アルビス	—	2.3	4,797	東京TYフィナンシャルG	7.5	8.3	23,430	愛媛銀行	37	31	7,967
コナカ	9.1	11	5,423	九州フィナンシャルG	—	86	55,126	トマト銀行	46	85	13,005
コーナン商事	10.6	8.9	17,043	ゆうちょ銀行	—	150.5	184,362	みなと銀行	52	57	9,462
ワタミ	8.6	9	10,440	コンコルディア・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	おおぞら銀行	390	372	132,060	栃木銀行	32	33	13,827
センショーホールディングス	28.5	29.4	52,243	三菱UFJフィナンシャルG	4,488.1	4,616.9	2,379,550	北日本銀行	2.5	2.8	7,767
幸楽苑ホールディングス	6.2	5.6	8,635	リソナホールディングス	655.7	673.8	292,429	東和銀行	87	91	8,008

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首			銘柄	期首			銘柄	期首		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
福島銀行	99	102	9,282	東京建物	62.5	62.8	76,239	ユー・エス・エス	70.8	73	123,881
大東銀行	55	61	10,492	ダイビル	16.3	15.7	13,784	東京個別指導学院	1.4	—	—
トモニホールディングス	46.4	45.2	21,470	京阪神ビルディング	16.1	11.8	5,982	サイバーエージェント	13.9	16.2	89,748
フィデアホール	40	55.5	8,769	住友不動産	133	138	359,559	楽天	275.5	310.8	412,742
池田泉州HD	47.1	53	24,963	大京	90	107	18,832	セントラルスポーツ	4	3	7,230
証券・商品先物取引業 (1.0%)				テオーシー	20.9	23	17,733	フルキャストホールディングス	4.8	8	6,704
F P G	16	21.2	19,504	東京築天地	16	19	9,120	テフプロ・ホールディング	7.7	10.3	35,586
S B Iホールディングス	67.9	68.8	81,321	レオパレス21	62.6	67.8	45,493	ジャパンマテリアル	1.9	3.2	11,056
ジャフコ	8.1	10	29,000	スターツコーポレーション	7.7	6.9	12,137	ベクトル	—	8.4	7,551
大和証券G本社	51.9	52.7	302,656	フジ住宅	13	12.2	8,308	キャリアリンク	0.3	—	—
野村ホールディングス	1,139.2	1,092.9	504,045	空浩施設	10.9	12.1	6,050	N・フィールド	1.7	—	—
岡三証券グループ	49	42	21,504	住友不動産販売	4.1	4.6	9,181	リクルートホールディングス	88.9	124.1	475,923
丸三証券	19.8	19.2	16,185	ゴールドクレスト	5.6	4.9	7,928	日本郵政	—	180.8	241,910
東洋証券	31	35	6,335	タカラレーベン	27.8	27.1	17,723	リログループ	2.2	2.4	37,032
東海東京HD	65.6	64.7	32,285	サンヨーハウジ 名古屋	5.9	5.9	5,186	東祥	0.7	2.2	9,878
光世証券	—	68	7,820	イオンモール	36	36	52,848	エイチ・アイ・エス	10	10	26,040
水戸証券	24.8	27.5	6,765	トーセイ	10.5	11.1	8,003	共立メンテナンス	3.8	4.7	30,315
いよよし証券	13.8	16.2	13,332	エヌ・ティ・ティ都市開発	36.4	34.4	32,748	イチメンホールディングス	10.2	11.7	10,834
松井証券	29.4	23.5	21,502	サンフロンティア不動産	7.1	8.5	8,321	建設技術研究所	4.8	5.7	5,130
マネックスG	70.1	74.4	17,930	エフ・ジェー・ネクスト	—	14.9	7,673	東京デリアル	47	98	11,662
カブドットコム証券	54.2	55.8	18,525	日本空港ビルデング	19.4	18.2	72,527	よみうりランド	17	18	8,442
極東証券	9.4	9.9	13,295	サービス業 (3.8%)				東京都競馬	47	45	8,955
岩井コスモホールディング	7.2	7.8	7,176	日本工営	25	23	9,821	常磐興産	44	79	12,245
監理證券	5	14.1	7,966	ネクスト	16.2	18.6	13,968	カナモト	8.7	8.6	20,700
マネースクウェアHD	1.4	7.8	9,703	日本M&Aセンター	9.7	9.7	58,200	東京ドーム	48	26	25,480
保険業 (2.4%)				アユーディア・ゴルフ	24.2	16.7	17,785	西尾レントオール	5.2	5.1	13,856
かんぽ生命保険	—	24.4	55,510	タケエィ	8.1	9.3	7,412	トランス・コスモス	8.4	7.6	19,760
損保ジャパン興亜HD	124.2	126.9	401,004	パソナグループ	3.5	7.4	5,705	乃村工務社	13	13.9	19,293
アニコム ホールディングス	2.5	5.2	12,594	G C A	6	8.6	6,389	藤田観光	27	25	8,975
MS & A D	178.3	170.3	495,487	エス・エム・エス	7.5	8.6	20,347	KNT-CTホールディングス	33	37	4,329
SONY F H	54	56.5	83,789	テンブホールディングス	12.1	43.6	70,457	日本財財	4	6.2	9,399
第一生命	358.2	365.3	525,484	クックパッド	12.6	14.5	14,007	トーカイ	3.3	3.1	10,168
東京海上HD	226.7	231.8	903,324	エスクリ	0.9	—	—	セコム	57.3	63.4	481,586
T & Dホールディングス	203.9	207.8	253,931	学情	1.4	—	—	丹青社	12.6	13.6	9,846
その他金融業 (1.3%)				スタジオアリス	3.8	3.6	7,725	メイテック	8.5	7.8	27,378
全国保証	15.1	15.2	61,332	ジミックホールディングス	3.6	4.2	6,039	アサツキ ディー・ケー	11.5	10.7	27,338
クレディセゾン	45.9	43.5	75,255	総合警備保障	19.9	20.7	104,949	応用地質	7.4	7.4	7,666
アクリティア	1.9	—	—	カカココム	40.1	44.5	78,275	船井総研ホールディン	8.7	9.9	14,384
芙蓉総合リース	6.2	6.7	32,897	アイロムグループ	0.8	—	—	ベネッセホールディングス	20.9	20	52,600
興銀リース	11.2	11.1	22,344	ディップ	7.5	7.6	22,625	イオンディライト	6.2	6.2	18,438
東京センチュリーリース	13.3	13.4	48,843	新日本科学	7.1	—	—	ナック	5.7	—	—
日本証券金融	26.4	24.1	10,700	ツクィ	9.1	17	12,138	ニチイ学館	13.6	12	9,300
アイフル	93.3	98.2	30,834	エムスリー	51.8	54.1	165,275	ダイセキ	10.6	12.1	22,288
ポケットカード	—	9.4	4,794	ツカダ・グローバルHOLD	6.6	6.8	4,583				
リコーリース	5.3	4.9	12,960	アウトソーシング	2.3	3.3	11,946	合 計	株数・金額	95,120.9	96,137.1006
イオンフィナンシャルサービス	37.1	37.4	66,833	ウェルネット	1.5	6.3	8,328	銘柄数<比率>	1,395銘柄	1,397銘柄	113,492.368
アコム	113.3	122.6	59,951	ディー・エヌ・エー	29.8	28.1	107,342				
ジャックス	33	33	13,068	博報堂DYHLDGS	81.4	83.4	95,826	(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。		
オリコ	131.8	248.4	49,431	ぐるなび	7.5	7.5	19,747	(注2)	合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。		
日立キャピタル	11.4	13.9	31,024	エスアールジータカミヤ	3.3	—	—	(注3)	評価額の単位未満は切捨て。		
アプラスフィナンシャル	21	—	—	一休	5.5	—	—				
オリックス	394.5	408.8	601,140	ファンコミュニケーションズ	12.6	15.9	11,829				
三菱UFJリース	138.1	141.1	65,047	インフォマート	—	13	13,286				
日本取引所グループ	81.6	166.7	269,053	J Pホールディングス	21.1	22.2	6,060				
イー・ギャラリーエン	1.2	3.1	8,063	E P Sホールディングス	7.1	7.7	10,387				
NECキャピタルリソリューション	3.6	3.4	5,589	プレステージ・インター	6.8	6.7	10,452				
不動産業 (2.5%)				アミューズ	2.4	4.2	7,543				
いちじ	—	60.9	26,004	ドリームインキュベータ	1.4	3.6	7,254				
日本駐車場開発	73.7	78.1	10,855	クイック	1.6	—	—				
ヒューリック	115	120	118,440	ケネディクス	83.5	82.3	37,858				
野村不動産HLDGS	33.8	37	62,900	電通	65.9	68.1	361,611				
三井交通グループHD	—	14.7	5,615	イオンファンタジー	—	3	7,851				
日本商業開発	1	—	—	ネクシィーズグループ	1.5	—	—				
プレサンスコーポレーション	2.5	2.3	9,729	みからホールディングス	15.2	15.3	77,418				
ユニホールディングス	2.6	4.1	11,496	アルプス技研	1.7	3.8	8,029				
日本管理センター	2.8	5.5	6,710	オリエンタルランド	63.7	66.3	408,474				
オープンハウス	8	8.9	20,203	ダスキン	16.9	17.3	31,849				
東急不動産HD	150	139.3	75,500	明光ネットワークジャパン	8.3	8.9	8,588				
飯田GH D	35.7	52.6	101,518	ファルコホールディングス	5.1	4.1	5,362				
パーク24	28.8	29	89,465	ラウンドダウン	19.1	20.8	14,851				
三井不動産	296	305	633,332	リゾートトラスト	22.9	25.2	51,332				
三菱地所	415	431	807,263	ピー・エム・エル	4.1	8	20,728				
平和不動産	13.4	12.2	16,616	りらいあコミュニケーション	12.5	11	10,120				

銘柄別	当期末		
	買建額	売建額	評価額
国内	百万円	百万円	百万円
TOPIX	208	—	—

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

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

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

(注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券へ1,418,700株を貸付しています。

■投資信託財産の構成

2016年9月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	113,492,368	96.0
コール・ローン等、その他	4,748,839	4.0
投資信託財産総額	118,241,208	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年9月20日現在

当 期 末	
項 目	
(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

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

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第17期（決算日 2016年11月30日）

（計算期間 2015年12月1日～2016年11月30日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

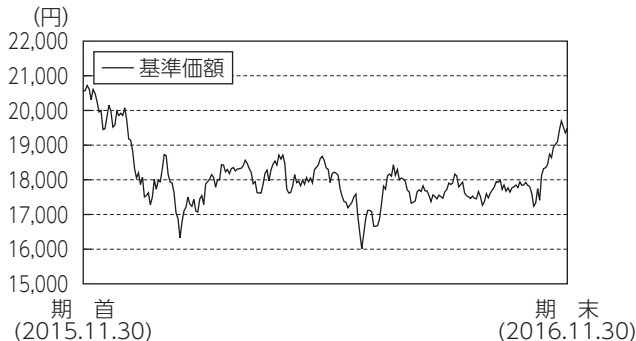
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



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

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：20,561円 期末：19,489円 騰落率：△5.2%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外株式市況

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

○為替相場

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

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

(注 2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2015年12月 1 日から2016年11月30日まで)

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

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

(注 1) 金額は受渡し代金。

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

(注 3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

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

■主要な売買銘柄
株 式

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	期 首	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千アメリカ・ドル		邦貨換算金額 千円
(アメリカ)	百株	百株			
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	—	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
VR BERKLEY CORP	21	21	130	14,684	金融
AUTOZONE INC	6.7	6.7	529	59,521	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	47.21	55.71	499	56,159	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	—	209	791	88,955	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	24	26.5	203	22,843	公益事業
CELANESE CORP-SERIES A	33	33	254	28,625	素材
DR HORTON INC	71.66	79.66	229	25,827	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	21	21	99	11,145	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	30	55	332	37,389	ヘルスケア
AUTODESK INC	48	45.5	342	38,496	情報技術
MOODY'S CORP	39	40.5	409	46,026	金融
DEVON ENERGY CORP	82	109	459	51,661	エネルギー
ALBEMARLE CORP	24	26	223	25,122	素材
ATMOS ENERGY CORP	—	23	170	19,172	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	25	50	186	20,938	公益事業
CITIGROUP INC	643.23	661.23	3,671	412,710	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	101	106	1,028	115,637	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	105	115	704	79,211	公益事業
NETSUITE INC	8	—	—	—	その他
ALLEGHANY CORP	3.5	3.5	199	22,384	金融
DUN & BRADSTREET CORP	7.5	9	110	12,455	資本財・サービス
DOMINO'S PIZZA INC	—	11	187	21,130	一般消費財・サービス
HESS CORP	57	65	318	35,842	エネルギー
DAVITA INC	36	38	241	27,195	ヘルスケア
DANAHER CORP	131	142.5	1,127	126,765	ヘルスケア
FORTIVE CORP	—	72	398	44,744	資本財・サービス
AVNET INC	28	28	129	14,508	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	23.7	135	740	83,229	金融

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

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期 首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	株 数	株 数	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 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
LOCKHEED MARTIN CORP	57	61.5	1,639	184,308	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	17	21	314	35,339	情報技術
L BRANDS INC	53	56	402	45,296	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	203	205	1,449	162,958	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	211	227.5	1,527	171,739	ヘルスケア
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	65	69	387	43,570	電気通信サービス
LAM RESEARCH CORP	33	37	398	44,744	情報技術
RANGE RESOURCES CORP	37	43	156	17,581	エネルギー
JONES LANG LASALLE INC	9	10	101	11,382	不動産
LOEWS CORP	61	65	288	32,459	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	54.49	54.49	345	38,788	金融
MCDONALD'S CORP	205	194	2,341	263,196	一般消費財・サービス
3M CO	135	139	2,401	269,976	資本財・サービス
FACEBOOK INC-A	456	531.5	6,424	722,213	情報技術
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	—	52.54	279	31,464	情報技術
MANPOWERGROUP INC	17	17	144	16,267	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	58	61.5	735	82,696	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	12	14	305	34,389	素材
CONCHO RESOURCES INC	28	32.5	413	46,521	エネルギー
PHILLIPS 66	117	110	906	101,885	エネルギー
MURPHY OIL CORP	36	36	105	11,906	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	93	108	311	35,052	一般消費財・サービス
MATTEL INC	72	78	246	27,674	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	25	26.5	246	27,744	生活必需品
MYLAN NV	87	104.5	376	42,362	ヘルスケア
METLIFE INC	203	213.5	1,156	130,065	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	84	105	150	16,974	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	34.28	36.78	298	33,537	情報技術
MONSANTO CO	102.06	100.56	1,029	115,751	素材
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	6	253	28,444	ヘルスケア
ROCKWELL AUTOMATION INC	28	29.5	387	43,557	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	598.21	638.71	3,972	446,547	ヘルスケア
MASCO CORP	74	74	238	26,795	資本財・サービス
M & T BANK CORP	32.19	33.69	474	53,323	金融
MARSH & MCLENNAN COS	115	121.5	838	94,219	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	47.82	75.22	595	66,897	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	22	26.5	222	25,039	情報技術
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	44	39.5	188	21,186	一般消費財・サービス
TOWERS WATSON & CO-CL A	15	—	—	—	その他
VANTIV INC - CL A	33	35.5	205	23,147	情報技術
FIREEYE INC	22	—	—	—	情報技術
REALOGY HOLDINGS CORP	32	—	—	—	不動産
NETAPP INC	67	67	244	27,499	情報技術
NIKE INC -CL B	146	305.5	1,546	173,885	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	65	67.5	704	79,199	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	45	48.5	320	36,001	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	27	30	213	23,979	金融
ALLY FINANCIAL INC	93	102	196	22,096	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	39	39.5	994	111,814	資本財・サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	62	62	393	44,217	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	115	120	402	45,260	素材
ADT CORP/THE	39.62	—	—	—	その他
MCKESSON CORP	49	51.5	727	81,778	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	60	64	254	28,599	情報技術

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期 首	当	期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・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 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円	
BANK OF AMERICA CORP	2,223.01	2,325.01	4,717	530,335	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	34	38	329	37,037	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	30	169	19,004	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	195	178	1,272	143,056	金融
ANALOG DEVICES INC	67	70	521	58,650	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	60	60	243	27,405	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	285.72	243.22	1,539	173,025	金融
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	14	14	160	18,009	素材
ANADARKO PETROLEUM CORP	109	127	764	85,892	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	41	44	339	38,196	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	38	40.5	335	37,753	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	—	45	175	19,780	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	25	25	131	14,732	ヘルスケア
AVERY DENNISON CORP	19	21	153	17,222	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	131	141.5	787	88,493	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	141	148.5	807	90,817	資本財・サービス
AON PLC	60	62	704	79,214	金融
AMGEN INC	162	174	2,540	285,591	ヘルスケア
CORE LABORATORIES N.V.	10	10	106	11,933	エネルギー
COACH INC	59	64	239	26,908	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	100.86	104.36	685	77,068	資本財・サービス
CELGENE CORP	169	179	2,186	245,764	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	37	41.2	641	72,161	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	260	245	787	88,577	情報技術
CIT GROUP INC	39	45	180	20,316	金融
CIMAREX ENERGY CO	19	22.5	278	31,362	エネルギー
CME GROUP INC	69	78	878	98,797	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	82.44	88.44	306	34,400	エネルギー
ECOLAB INC	58	61.5	715	80,483	素材
EQUIFAX INC	26	27.5	328	36,888	資本財・サービス
GAP INC/THE	50	58	146	16,457	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	311	306	2,291	257,556	ヘルスケア
ST JUDE MEDICAL INC	59	64.5	514	57,791	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	41.48	43.98	393	44,226	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	32	68.5	242	27,314	生活必需品
STATE STREET CORP	89.43	91.93	707	79,588	金融
STAPLES INC	136	156	153	17,204	一般消費財・サービス
SUNTRUST BANKS INC	110.48	115.98	593	66,678	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	252	274	1,053	118,468	金融
IHS INC-CLASS A	15	—	—	—	その他
BAXTER INTERNATIONAL INC	116	114	510	57,363	ヘルスケア
B/E AEROSPACE INC	23	23	137	15,490	資本財・サービス
CAMPBELL SOUP CO	40	46	265	29,812	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	31	31	172	19,390	素材
CHUBB CORP	49	—	—	—	その他
CARDINAL HEALTH INC	71	75.5	535	60,254	ヘルスケア
FEDEX CORP	57	58.5	1,113	125,165	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	116.54	114.04	941	105,896	金融
FMC CORP	28	32	175	19,713	素材
FLUX 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	期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
	百株	百株	千円	千円	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	41	—	—	—	その他
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	88	88	214	24,079	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	92	91	426	48,000	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	70	74	929	104,495	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	553	450	207	23,321	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC	30	33.5	457	51,418	ヘルスケア
CHESAPEAKE ENERGY CORP	119	—	—	—	エネルギー
SEALED AIR CORP	44	44	206	23,243	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	8	8.7	565	63,603	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	—	31	252	28,434	情報技術
SNAP-ON INC	12	13	218	24,524	資本財・サービス
CALPINE CORP	72	72	83	9,332	公益事業
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	43	—	—	—	その他
CARMAX INC	46	46	264	29,740	一般消費財・サービス
COMERICA INC	40	40	247	27,767	金融
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	23	—	—	—	資本財・サービス
INGREDION INC	—	16	192	21,624	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	148.28	158.28	1,208	135,891	公益事業
TARGET CORP	130	129	1,011	113,711	一般消費財・サービス
DOVER CORP	35	35	244	27,456	資本財・サービス
VWV GRAINGER INC	13	13	294	33,080	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	26	29	178	20,121	資本財・サービス
JOHNSON CONTROLS INC	142	—	—	—	その他
CINTAS CORP	21	21	242	27,286	資本財・サービス
CA INC	71.05	71.05	230	25,943	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	90	95	358	40,284	生活必需品
CLOROX COMPANY	28	29.5	347	39,030	生活必需品
ENTERGY CORP	38	42.5	303	34,113	公益事業
MICROSOFT CORP	1,614	1,693.5	10,345	1,163,051	情報技術
INCYTE CORP	34	38.5	404	45,476	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	239.74	247.24	1,876	210,906	生活必需品
MEDTRONIC PLC	301.88	316.38	2,322	261,136	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	230	241	468	52,615	情報技術
BLACKROCK INC	26	28.5	1,050	118,082	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	91	91	219	24,644	公益事業
HASBRO INC	24	26	225	25,318	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	56	61	449	50,485	生活必需品
KEYCORP	184	245	416	46,850	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	24	24	211	23,729	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	347.11	356.11	1,526	171,585	生活必需品
KOHL'S CORP	44	44	238	26,780	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	10	11	187	21,041	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	100	111	176	19,878	金融
APACHE CORP	81.1	87.6	532	59,816	エネルギー
CHUBB LTD	70	107.99	1,384	155,686	金融
ARROW ELECTRONICS INC	20	20	136	15,379	情報技術
ALLSTATE CORP	89	87	605	68,101	金融
EBAY INC	237	250	712	80,127	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC	234	249.5	995	111,886	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	32	35	257	28,994	素材
XILINX INC	56	59.5	321	36,127	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	155.1	143.1	1,099	123,647	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP-A	47	53	305	34,373	一般消費財・サービス
YAHOO! INC	193	210	873	98,210	情報技術

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

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期 首	当	期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	87	91.5	969	81,168	金融
TORONTO-DOMINION BANK	404	437	2,800	234,365	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	67	67	238	19,970	金融
MEG ENERGY CORP	38	—	—	—	エネルギー
ROYAL BANK OF CANADA	315	348.5	3,140	262,812	金融
TOURMALINE OIL CORP	38	47	164	13,737	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	25	25	128	10,725	エネルギー
TRANSCANADA CORP	154	189.5	1,145	95,873	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	75	94	361	30,275	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	366	454	86	7,218	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	245	273	566	47,402	素材
CAE INC	74	58	114	9,604	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	78.04	78.04	454	38,046	金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	178	202	476	39,858	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	39	39	71	5,991	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	14	14	67	5,664	素材
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	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
HUSKY ENERGY INC	74	75.58	111	9,297	エネルギー
ONEX CORPORATION	20	20	189	15,835	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	87	95	252	21,098	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	39	39	101	8,485	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	34	34	190	15,981	資本財・サービス
ELDORADO GOLD CORP	172	172	62	5,224	素材
IGM FINANCIAL INC	23	23	86	7,236	金融
OPEN TEXT CORP	28	28	238	19,955	情報技術
CI FINANCIAL CORP	48	54	144	12,069	金融
SAPUTO INC	58	58	270	22,670	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	147	171	249	20,891	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	90	98	629	52,672	生活必需品
YAMANA GOLD INC	201	233	93	7,818	素材
YAMANA GOLD INC-RTS	-	14.56	0	40	その他
FORTIS INC	61	96	392	32,880	公益事業
CRESCENT POINT ENERGY CORP	105	133	202	16,916	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	183	196	371	31,096	エネルギー
DOLLARAMA INC	27	27	278	23,303	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	-	17	73	6,131	公益事業
ALTAGAS LTD	31	39	125	10,469	エネルギー
FIRST CAPITAL REALTY INC	-	26	52	4,394	不動産
KEYERA CORP	40	40	149	12,481	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	34	39	126	10,560	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	74	81	219	18,409	エネルギー
CANADIAN OIL SANDS LTD	112	-	-	-	その他
ARC RESOURCES LTD	75	83	184	15,453	エネルギー
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 総株数<比率>	8,560.7 84銘柄	9,531 90銘柄	37,543 < 4.0%>	3,141,605
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD	-	375	86	7,257	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD	545	617	160	13,497	金融
BHP BILLITON LIMITED	702	752	1,914	161,093	素材
SOUTH32 LTD	1,182	1,272	356	29,967	素材
LENDELEASE GROUP	121	121	164	13,856	不動産
ASCIANO LTD	216	-	-	-	その他
ALUMINA LTD	699	699	118	9,968	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	161	182	552	46,461	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	397	397	246	20,710	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	118	118	141	11,934	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	570	620	1,783	150,031	金融
WESTPAC BANKING CORP	679.98	780.98	2,436	205,020	金融
SANTOS LTD	220	340	137	11,586	エネルギー
AUSNET SERVICES	-	410	60	5,122	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	602	689	1,935	162,844	金融
RIO TINTO LTD	97	97	585	49,287	素材
ORIGIN ENERGY LTD	364	414	250	21,039	エネルギー
AMCOR LIMITED	267	267	387	32,597	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	468	468	235	19,846	資本財・サービス
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	-	100	43	3,660	電気通信サービス
OIL SEARCH LTD	-	329	217	18,325	エネルギー
SEEK LTD	75	75	110	9,320	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	146	171	185	15,639	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	176	176	343	28,862	素材

銘柄	期 首		当 期		未 期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額				
			外貨建金額 千オーストラリア・ドル	邦貨換算金額 千円			
INCITEC PIVOT LTD	456	456	147	12,392	素材		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	370	401	3,118	262,363	金融		
CALTEX AUSTRALIA LTD	60	60	179	15,119	エネルギー		
ORICA LTD	83	83	145	12,200	素材		
QBE INSURANCE GROUP LTD	306	328	364	30,633	金融		
CIMIC GROUP LTD	29	29	90	7,630	資本財・サービス		
WOOLWORTHS LTD	281	300	691	58,182	生活必需品		
COCA-COLA AMATIL LTD	137	137	131	11,100	生活必需品		
TABCORP HOLDINGS LTD	205	205	96	8,089	一般消費財・サービス		
CROWN RESORTS LTD	106	106	122	10,328	一般消費財・サービス		
QANTAS AIRWAYS LTD	145.54	145.54	46	3,894	資本財・サービス		
TELSTRA CORP LTD	936	986	496	41,812	電気通信サービス		
AMP LTD	665	665	315	26,577	金融		
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	114	114	237	19,970	素材		
MACQUARIE GROUP LTD	64.84	72.84	605	50,942	金融		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	126	187	15,754	一般消費財・サービス		
BANK OF QUEENSLAND LTD	—	91	102	8,598	金融		
CSL LTD	103	106	1,048	88,198	ヘルスケア		
WESFARMERS LTD	244.45	267.45	1,124	94,626	生活必需品		
COCHLEAR LTD	17	14	165	13,958	ヘルスケア		
SUNCORP GROUP LTD	287	312	389	32,762	金融		
BORAL LTD	227	227	113	9,588	素材		
BORAL LTD-RTS	—	102.25	2	219	その他		
ASX LTD	42	42	203	17,139	金融		
COMPUTERSHARE LTD	139	139	163	13,718	情報技術		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	140	65	5,536	一般消費財・サービス		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	511	549	309	26,006	金融		
SONIC HEALTHCARE LTD	95	95	206	17,393	ヘルスケア		
TRANSURBAN GROUP	424	478	499	42,028	資本財・サービス		
TRANSURBAN GROUP-RIGHTS	23.55	—	—	—	その他		
ILUKA RESOURCES LTD	120	—	—	—	素材		
CHALLENGER LTD	—	122	130	11,014	金融		
SYDNEY AIRPORT	251	251	156	13,199	資本財・サービス		
TATTS GROUP LTD	369	369	155	13,071	一般消費財・サービス		
AGL ENERGY LTD	152	152	318	26,793	公益事業		
BRAMBLES LTD	349	373	444	37,409	資本財・サービス		
APA GROUP	242	267	213	17,927	公益事業		
DUET GROUP	—	500	119	10,012	公益事業		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	29	33	236	19,908	ヘルスケア		
TPG TELECOM LTD	—	65	45	3,828	電気通信サービス		
REA GROUP LTD	—	12	61	5,214	一般消費財・サービス		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	14	95	8,034	一般消費財・サービス		
オーストラリア・ドル 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	15,529.36 54銘柄	18,405.06 63銘柄	-25,803 < 2.7%>	2,171,113 < 2.7%>		
(香港)	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		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港ドル	千円	
CLP HOLDINGS LTD	410	425	3,240	46,989	公益事業
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	330	330	343	4,985	資本財・サービス
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	258.06	283.86	1,216	17,636	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,494.93	1,811.42	2,626	38,085	公益事業
HANG SENG BANK LTD	168	179	2,620	37,998	金融
WHEELLOCK & CO LTD	250	250	1,076	15,605	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,130	1,290	1,104	16,011	不動産
WH GROUP LTD	—	1,350	854	12,390	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	245	273	5,558	80,595	金融
LI & FUNG LTD	1,320	1,320	447	6,488	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	520	520	895	12,983	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	65	65	487	7,068	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	210	210	582	8,449	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	465	465	641	9,304	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	180	180	376	5,454	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	290.4	290.4	939	13,621	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	—	140	469	6,800	不動産
SJM HOLDINGS LTD	470	470	289	4,204	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	300	300	676	9,809	不動産
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	596.69	641.69	3,333	48,336	不動産
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	150	150	979	14,202	公益事業
PCCW LTD	—	950	424	6,157	電気通信サービス
AIA GROUP LTD	2,628	2,830	13,315	193,069	金融
SANDS CHINA LTD	540	572	2,225	32,263	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	300	300	257	3,736	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	315	315	937	13,588	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	200	200	340	4,930	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	825	875	2,537	36,793	金融
WYNN MACAU LTD	380	380	529	7,680	一般消費財・サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	570	570	566	8,215	電気通信サービス
香 港 ド ル 株数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	18,012.77 35銘柄	21,468.06 38銘柄	-68,937 < 1.3%>	999,599 < 1.3%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	290	300	602	47,571	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	385	415	720	56,860	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	124.7	124.7	122	9,709	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	315	345	185	14,684	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	132	132	76	6,045	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	112	112	92	7,323	不動産
CAPITALAND LTD	590	590	178	14,117	不動産
SEMBCORP MARINE LTD	250	—	—	—	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	410	410	152	12,044	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30	30	118	9,369	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	670	742	669	52,853	金融
GENTING SINGAPORE PLC	1,530	1,530	147	11,659	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,750.5	1,886.5	711	56,164	電気通信サービス
NOBLE GROUP LTD	1,151.81	—	—	—	資本財・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	350	350	115	9,148	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	290	290	79	6,252	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	2,194	2,194	95	7,536	生活必需品
SINGAPORE EXCHANGE LTD	190	190	136	10,773	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	468	468	117	9,239	資本財・サービス
STARHUB LTD	—	160	45	3,626	電気通信サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	当 期 末		業 種 等
			評 価 額	外貨建金額 邦貨換算金額	
		百株	百株	千円	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	560	560	199	15,743	生活必需品
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	690	690	140	11,115	不動産
シンガポール・ドル 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	12,483.01 21銘柄	11,519.2 20銘柄	4,708 ----- < 0.5%>	371,840
(ニュージーランド)		百株	百株	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	—	260	66	5,362	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	526.89	526.89	184	14,841	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	234	234	142	11,454	資本財・サービス
CONTACT ENERGY LTD	130	130	61	4,934	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	201	201	217	17,420	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	—	53	45	3,632	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,091.89 4銘柄	1,404.89 6銘柄	718 ----- < 0.1%>	57,646
(イギリス)		百株	百株	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT	141	163	71	10,057	一般消費財・サービス
TUI AG-DI	107.47	117.47	123	17,374	一般消費財・サービス
BP PLC	3,979	4,363	1,930	271,206	エネルギー
UNILEVER PLC	277.6	301.1	942	132,375	生活必需品
BARCLAYS PLC	3,657	3,975	851	119,621	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	394	434	292	41,025	資本財・サービス
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL	36,523.8	—	—	—	その他
MARKS & SPENCER GROUP PLC	353	381	125	17,569	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	19	23	134	18,882	素材
REXAM PLC	151.6	—	—	—	その他
PRUDENTIAL PLC	563	602	930	130,767	金融
INMARSAT PLC	94	103	74	10,438	電気通信サービス
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	681.91	792.91	156	21,940	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	44.09	45.64	143	20,135	素材
BAE SYSTEMS PLC	677	761	457	64,294	資本財・サービス
AVIVA PLC	883.66	939.66	424	59,617	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,061.02	1,150.02	1,734	243,589	ヘルスケア
MELROSE INDUSTRIES PLC	240.42	—	—	—	資本財・サービス
WORLDPAY GROUP PLC	—	427	115	16,283	情報技術
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	80	56	7,893	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	—	252	101	14,264	情報技術
DCC PLC	—	20	122	17,136	資本財・サービス
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	—	19,964	1	280	その他
ROYAL MAIL PLC	171	224	104	14,617	資本財・サービス
RELX PLC	247.46	256.46	353	49,674	資本財・サービス
BG GROUP PLC	744	—	—	—	その他
DIAGEO PLC	549	594	1,194	167,825	生活必需品
RIO TINTO PLC	276	291.5	894	125,575	素材
STANDARD CHARTERED PLC	557	783	494	69,430	金融
TESCO PLC	1,753	1,911	399	56,059	生活必需品
FRESNILLO PLC	50	50	61	8,666	素材
SMITH & NEPHEW PLC	193	215	242	34,064	ヘルスケア
GLENCORE PLC	2,369.25	2,909.25	818	114,968	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	57	57	67	9,503	金融
SMITHS GROUP PLC	84.33	93.33	130	18,352	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	61	61	57	8,118	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	298.83	339.83	119	16,806	金融
DIXONS CARPHONE PLC	209	248	83	11,683	一般消費財・サービス
PEARSON PLC	173.63	188.63	146	20,626	一般消費財・サービス

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

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB	13	19	518	6,356	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	655.3	722.3	3,406	41,727	情報技術
VOLVO AB-B SHS	324	345	3,372	41,311	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	15	15	587	7,195	電気通信サービス
SKF AB-B SHARES	86.5	86.5	1,403	17,197	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	54.5	54.5	1,167	14,300	一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB	654.5	706.5	6,743	82,608	金融
SWEDISH MATCH AB	45.5	45.5	1,322	16,197	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	89.5	89.5	627	7,685	電気通信サービス
GETINGE AB-B SHS	47	47	677	8,296	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A SHS	320.5	341.5	3,114	38,152	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	321	352	4,403	53,943	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	199	213	4,498	55,107	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	208	217	5,815	71,241	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	124	141	3,443	42,179	生活必需品
SKANSKA AB-B SHS	82.5	82.5	1,723	21,111	資本財・サービス
SANDVIK AB	223.5	244.5	2,650	32,467	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	101	108	3,333	40,841	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	144	157	4,322	52,947	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	92	92	1,213	14,865	資本財・サービス
TELIA CO AB	558	600	2,080	25,489	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB	70	70	967	11,850	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	83	91	2,224	27,255	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	211	233	3,961	48,522	資本財・サービス
LUNDIN PETROLEUM AB	64	64	1,054	12,920	エネルギー
BOLIDEN AB	60	60	1,426	17,478	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	125.5	125.5	852	10,446	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B	53	53	1,187	14,549	金融
HEXAGON AB-B SHS	55.5	62	1,957	23,985	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	—	35	559	6,851	金融
スウェーデン・クロス 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,080.3 29銘柄	5,472.8 30銘柄	70,619 865,083 < 1.1%>	
ユーロ (アイルランド)	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 銘柄数<比率>	6,827 3銘柄	6,869.5 4銘柄	1,184 141,808 < 0.2%>	
ユーロ (オランダ)	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
BOSKALIS WESTMINSTER	21	21	61	7,337	資本財・サービス
ING GROEP NV	847.5	918.5	1,159	138,804	金融

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

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

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

銘柄		期 首		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外貨建金額 邦貨換算金額	
		百株	百株	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
TERNIA 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 < 0.6%>	
ユーロ（フィンランド）		百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ		113	124	266	31,882	素材
NOKIA OYJ		776.5	1,358.5	546	65,370	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		32	32	127	15,244	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		131	131	118	14,222	素材
METSO OYJ		30	30	78	9,437	資本財・サービス
ELISA OYJ		35.5	35.5	106	12,701	電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS		96.5	103	427	51,116	金融
FORTUM OYJ		94.5	104.5	143	17,136	公益事業
KONE OYJ-B		66.5	78.5	323	38,685	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ		30	30	100	12,054	電気消費財・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 < 0.4%>	
ユーロ（オーストリア）		百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG		35.5	35.5	105	12,609	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		55.5	66.5	171	20,528	金融
VOESTALPINE AG		28.5	28.5	101	12,190	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL		24	24	40	4,895	金融
ANDRITZ AG		16	16	77	9,230	資本財・サービス
国 小 計		株数、金額 銘柄数<比率>	159.5 5銘柄	170.5 5銘柄	496 < 0.1%>	
ユーロ（その他）		百株	百株	千ユーロ	千円	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		—	52	162	19,460	生活必需品
STMICROELECTRONICS NV		137	153	142	17,052	情報技術
国 小 計		株数、金額 銘柄数<比率>	137 1銘柄	205 2銘柄	305 < 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 < 1.15%>	
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	期末	
	□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,847	3,197	526	59,215
SIMON PROPERTY GROUP INC	6,587	7,187	1,310	147,291
BOSTON PROPERTIES INC	3.3	3.6	450	50,694
GENERAL GROWTH PROPERTIES	12.1	13.6	348	39,231
VORNADO REALTY TRUST	3,627	3,827	379	42,635
EQUITY RESIDENTIAL	7.9	8.5	514	57,802
EQUINIX INC	1,158	1,608	552	62,075
AMERICAN TOWER CORP	9.1	9.75	1,033	116,240
HOTEL & RESORTS INC	16,093	17,293	299	33,632
KIMCO REALTY CORP	8.7	10	260	29,274
PLUM CREEK TIMBER CO	3.7	—	—	—
VENTAS INC	7	7.9	482	54,237
WEYERHAEUSER CO	11,094	17,614	548	61,701
AGNC INVESTMENT CORP	7.8	7.8	148	16,669
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	6.9	172	19,446
CROWN CASTLE INTL CORP	7.2	7.75	660	74,257
IRON MOUNTAIN INC	3.91	5.61	189	21,272
VEREIT INC	20.4	22.3	189	21,359
PROLOGIS INC	11,062	12,262	630	70,909
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	—	1.7	189	21,351
CAMDEN PROPERTY TRUST	1.8	2	158	17,820
DUKE REALTY CORP	7.3	8	206	23,212
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.4	1.48	319	35,916
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1.5	1.6	226	25,505
WELLTOWER INC	7.4	8.3	532	59,894
HCP INC	9.7	10.7	316	35,605
LIBERTY PROPERTY TRUST	3.3	3.3	131	14,739
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	1.7	159	17,928
MACERICH CO/THE	3	3	207	23,321
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	19.8	23.2	240	27,046
REALTY INCOME CORP	4.8	6	340	38,272
PUBLIC STORAGE	3.1	3.4	712	80,118
REGENCY CENTERS CORP	2.1	2.3	153	17,298
SL GREEN REALTY CORP	2.1	2.25	238	26,819
UDR INC	5.7	6.3	215	24,214
DIGITAL REALTY TRUST INC	2.8	3.7	345	38,891
EXTRA SPACE STORAGE INC	2.3	2.75	194	21,903
アメリカ・ドル 通 貨 計	221,678 34銘柄	258,378 36銘柄	13,590	1,527,811 <1.9%>
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	—	1.5	47	3,952
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	—	3	65	5,470
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	—	3.3	88	7,442
カナダ・ドル 通 貨 計	— 3銘柄	7.8 3銘柄	201	16,864 <0.0%>
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
SCENTRE GROUP	116,322	121,922	513	43,188
DEXUS PROPERTY GROUP	23.95	23.95	216	18,176
GPT GROUP	40.06	40.06	189	15,943
MIRVAC GROUP	93.4	93.4	190	16,031
STOCKLAND	51.5	57	244	20,574
WESTFIELD CORP	43,096	45,496	414	34,911
GOODMAN GROUP	38.2	41.7	273	23,051

銘柄	期首	当	期末	
	□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額
VICINITY CENTRES	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
	74,873	74,873	213	17,954
オーストラリア・ドル 通 貨 計	481,401 8銘柄	498,401 8銘柄	2,256	189,832 <0.2%>
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT	49.5	52	2,750	39,886
香港・ドル 通 貨 計	49.5 1銘柄	52 1銘柄	2,750	39,886 <0.1%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	48	48	110	8,756
CAPITALAND MALL TRUST	63.2	63.2	120	9,532
SUNTEC REIT	—	53	88	7,010
シンガポール・ドル 通 貨 計	111.2 2銘柄	164.2 3銘柄	320	25,299 <0.0%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	17.1	18.2	177	24,924
SEGRO PLC	16.75	19.95	83	11,729
HAMMERSON PLC	17.4	17.4	95	13,442
BRITISH LAND CO PLC	20.9	22.1	132	18,624
INTU PROPERTIES PLC	21.1	21.1	57	8,049
イギリス・ポンド 通 貨 計	93.25 5銘柄	98.75 5銘柄	546	76,770 <0.1%>
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO SE	2.15	2.36	497	59,577
ICADE	0.75	0.75	48	5,815
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。

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

項 目	当 期 末	評 価 額 比 率
	千円	%
株式	75,856,759	95.3
投資信託証券	1,984,502	2.5
コール・ローン等、その他	1,789,729	2.2
投資信託財産総額	79,630,991	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝112.42円、1カナダ・ドル＝83.68円、1オーストラリア・ドル＝84.14円、1香港ドル＝14.50円、1シンガポール・ドル＝78.97円、1ニュージーランド・ドル＝80.25円、1イギリス・ポンド＝140.46円、1イスラエル・シェケル＝29.32円、1スイス・フラン＝111.11円、1デンマーク・クローネ＝16.09円、1ノルウェー・クローネ＝13.18円、1スウェーデン・クローネ＝12.25円、1ユーロ＝119.70円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（78,796,718千円）の投資信託財産総額（79,630,991千円）に対する比率は、99.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年11月30日現在

項 目	当 期 末
(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 エマージングプラス（為替ヘッジなし）88,958,951円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）147,732,667円、D－I’s 外国株式インデックス1,957,148円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 182,021円、iFree 外国株式インデックス184,046,036円、iFree 8資産バランス31,235,406円、DCダイワ外国株式インデックス22,444,872,014円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 550,340,778円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 735,584,538円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 553,544,620円、大和DC海外株式インデックスファンド1,470,526,931円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 7,625,022円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 15,729,186円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 3,621,406円、ダイワ世界分散バランスファンド1 5 V A 100,000円、ダイワ世界分散バランスファンド2 0 V A 197,107円、ダイワ世界分散バランスファンド2 5 V A 19,292,523円、ダイワ世界分散バランスファンド3 0 V A 163,931,206円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A 1,955,664,069円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 519,301,921円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 5,011,815,577円、ダイワ・バランスファンド2 5 V A（適格機関投資家専用）231,056,464円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式399,881,832円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド17,952,452円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス3,006,649,223円、ダイワライフスタイル2 5 23,902,625円、ダイワライフスタイル5 0 78,118,426円、ダイワライフスタイル7 5 59,617,537円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,489円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月1日 至2016年11月30日

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

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

《お知らせ》

●投資信託証券への投資制限の変更

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

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

運用報告書 第25期（決算日 2016年9月15日）

（計算期間 2016年3月16日～2016年9月15日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

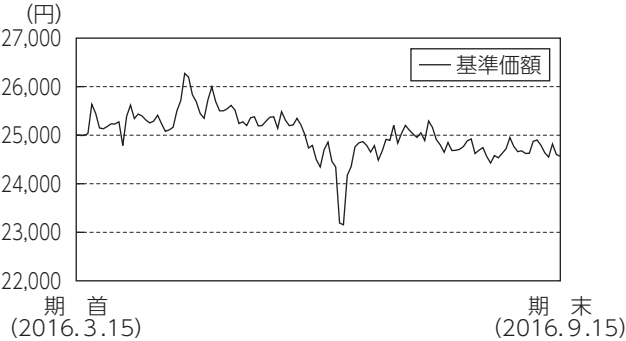
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		東証ＲＥＩＴ指数(配当込み)		投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指数先物 比率
	円	騰 落 率 %	ベンチマーク	騰 落 率 %	%	%
(期首)2016年3月15日	25,004	—	3,373.30	—	98.9	1.1
3月末	25,275	1.1	3,409.88	1.1	98.9	1.1
4月末	25,691	2.7	3,465.54	2.7	98.9	1.1
5月末	25,370	1.5	3,422.69	1.5	98.8	1.1
6月末	24,760	△1.0	3,340.35	△1.0	98.9	1.0
7月末	25,159	0.6	3,394.01	0.6	98.9	1.1
8月末	24,661	△1.4	3,325.60	△1.4	98.2	1.0
(期末)2016年9月15日	24,565	△1.8	3,310.77	△1.9	98.9	1.1

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：25,004円 期末：24,565円 騰落率：△1.8%

【基準価額の主な変動要因】

東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざした運用を行なった結果、英国の国民投票でＥＵ（欧州連合）離脱支持が多数となったことを受けてリスク回避姿勢が強まったことや、日銀政策決定会合においてＪ－ＲＥＩＴの追加買い入れがなかったことなどから市況が値下がりしたことを受け、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は、期首より、国内株式市況が横ばい圏で推移する中で国内リート市況も動意に欠ける展開となり、おおむね横ばいの値動きで始まりました。2016年4月末にかけては、日銀の追加緩和期待から上昇したものの、追加緩和が行なわれなかったことへの失望感から若干調整しました。6月には、ＥＵ残留か離脱かを問う英国の国民投票が離脱多数で決したことを受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、急速な円高と国内株式市況の急落が同時進行する中、国内リート市況も一時調整を余儀なくされました。しかし、長期金利の低下がさらに進行したことを受けて、下落前とほぼ同水準まで値を戻しました。7月末以降は、日銀政策決定会合において国内リーートの追加買い入れがなかったことが嫌気されて若干下落し、その後も緩やかな下落基調が続きました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（東証ＲＥＩＴ指数（配当込み））の騰落率は△1.9％となりました。一方、当ファンドの騰落率は△1.8％となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2016年3月16日から2016年9月15日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内	236.02	40,061,666	34.852 (-)	8,091,677 (-)

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2016年3月16日から2016年9月15日まで)

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	不動産投信指数先物取引	百万円 5,267	百万円 4,918	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

投資信託証券

(2016年3月16日から2016年9月15日まで)

当 期					期 付				
買		付			売		付		
銘	柄	□ 数	金 額	平均単価	銘	柄	□ 数	金 額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
ラサールロジポート投資		23.091	2,495,335	108,065	日本ビルファンド		1.048	718,073	685,184
日本ビルファンド		3.788	2,404,415	634,745	ジャパンリアルエステイト		0.971	658,419	678,083
ジャパンリアルエステイト		3.513	2,191,999	623,967	日本リテールファンド		1.893	504,990	266,767
ユナイテッド・アーバン投資法人		11.588	2,111,780	182,238	野村不動産マスターＦ		2.761	455,283	164,897
日本リテールファンド		6.847	1,740,047	254,132	ユナイテッド・アーバン投資法人		2.042	375,768	184,019
野村不動産マスターＦ		10.014	1,674,426	167,208	日本プライムリアルティ		0.649	303,228	467,223
オリックス不動産投資		9.049	1,624,030	179,470	アドバンス・レジデンス		0.964	274,160	284,398
ジャパン・ホテル・リート投資法人		18.09	1,604,542	88,697	ＡＰＩ投資法人		0.445	258,703	581,356
ＧＬＰ投資法人		12.121	1,547,913	127,705	ＧＬＰ投資法人		1.924	250,197	130,040
インヴィンシブル投資法人		16.293	1,213,921	74,505	大和証券オフィス投資法人		0.359	249,663	695,440

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

フ ア ン ド 名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
不動産投信	千口	千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人	10.105	4,461,357	1.8
MCUBS MidCity投資法人	5.548	1,794,778	0.7
森ヒルズリート	36.511	5,597,136	2.3
産業ファンド	7.353	3,904,443	1.6
アドバンス・レジデンス	27.113	7,301,530	3.0
ケネディクスレジデンシャル	7.281	2,000,818	0.8
A P I 投資法人	12.506	6,778,252	2.8
G L P 投資法人	59.258	7,739,094	3.2
コンフォリア・レジデンシャル	10.71	2,514,708	1.0
日本プロロジスリート	38.415	9,592,225	3.9
星野リゾート・リート	1.705	2,124,430	0.9
S I A不動産投資	1.96	734,020	0.3
イオンリート投資	27.31	3,400,095	1.4
ヒューリックリート投資法	19.959	3,448,915	1.4
日本リート投資法人	8.17	2,046,585	0.8
インベスコ・オフィス・Jリート	17.009	1,510,399	0.6
日本ヘルスケア投資法	1.557	280,571	0.1
積水ハウス・リート投資	18.645	2,722,170	1.1
トーセイ・リート投資法人	3.358	364,007	0.1
ケネディクス商業リート	8.811	2,185,128	0.9
ヘルスケア&メディカル投資	2.513	273,917	0.1
サムティ・レジデンシャル	5.902	479,832	0.2
ジャパン・シニアリビング	1.768	258,128	0.1
野村不動産マスターF	87.243	14,752,825	6.0
いちごホテルリート投資	5.304	757,411	0.3
ラサールロジポート投資	22.941	2,436,334	1.0
スターアジア不動産投	7.189	635,507	0.3
マリモ地方創生リート	1.897	162,952	0.1
日本ビルファンド	29.448	18,846,720	7.7
ジャパンリアルエステイト	27.307	16,848,419	6.9
日本リテールファンド	53.228	13,179,252	5.4
オリックス不動産投資	52.551	9,527,496	3.9
日本プライムリアルティ	18.207	8,429,841	3.5
プレミアム投資法人	27.467	3,694,311	1.5
東急リアル・エステート	20.389	2,811,643	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人	4.042	1,562,233	0.6
ユナイテッド・アーバン投資法人	61.588	11,369,144	4.7
森トラスト総合リート	27.53	4,993,942	2.0
インヴィンシブル投資法人	76.662	4,323,736	1.8
フロンティア不動産投資	10.344	5,223,720	2.1
平和不動産リート	21.165	1,765,161	0.7
日本ロジスティクスファンド投資法人	18.353	4,336,813	1.8
福岡リート投資法人	15.579	2,941,315	1.2

フ ア ン ド 名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
ケネディクス・オフィス投資法人	8.444	5,294,388	2.2
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	21.234	2,554,450	1.0
いちごオフィスリート投資法人	31.957	2,342,448	1.0
大和証券オフィス投資法人	10.383	6,416,694	2.6
阪急リート投資法人	12.461	1,735,817	0.7
スタートアップリート投資法人	3.624	599,409	0.2
大和ハウスリート投資法人	31.685	8,916,271	3.7
ジャパン・ホテル・リート投資法人	78.458	6,614,009	2.7
日本賃貸住宅投資法人	34.205	2,832,174	1.2
ジャパンエクセレント投資法人	27.231	3,896,756	1.6
合 計	□ 数、金 額 銘柄数<比率>	1,181,583 241,313,742 53銘柄	100.0% <98.9%>

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国 内	百万円 2,620	百万円 －

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年9月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託証券	241,313,742	98.7
コール・ローン等、その他	3,170,600	1.3
投資信託財産総額	244,484,342	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15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	244,863,819,827円
コール・ローン等	991,972,208
投資信託証券(評価額)	241,313,742,480
未収入金	88,750,968
未収配当金	2,089,444,171
差入委託証拠金	379,910,000
(B) 負債	788,684,300
未払金	396,119,300
未払解約金	6,790,000
差入委託証拠金代用有価証券	385,775,000
(C) 純資産総額(A－B)	244,075,135,527
元本	99,360,552,313
次期繰越損益金	144,714,583,214
(D) 受益権総口数	99,360,552,313口
1万口当り基準価額(C／D)	24,565円

*期首における元本額は87,794,304,356円、当期中における追加設定元本額は14,828,310,456円、同解約元本額は3,262,062,499円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン8,696,141,881円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）85,806,970,509円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）473,683,079円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 18,797円、i F r e e Ｊ－ＲＥＩＴインデックス7,715,352円、i F r e e 8 資産バランス2,505,020円、ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン3,180,595,022円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 3,219,086円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 4,456,384円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 799,155円、ダイワ・ノーロード Ｊ－ＲＥＩＴファンド47,385,672円、ダイワ・インデックスセレクト Ｊ－ＲＥＩＴ1,137,062,356円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は24,565円です。

■損益の状況

当期 自2016年3月16日 至2016年9月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,728,464,338円
受取配当金	3,641,504,680
受取利息	104
その他収益金	87,405,000
支払利息	△ 445,446
(B) 有価証券売買損益	△ 7,766,304,928
売買益	3,890,164,892
売買損	△ 11,656,469,820
(C) 先物取引等損益	△ 47,592,704
取引益	24,027,438
取引損	△ 71,620,142
(D) その他費用	△ 2,904
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	△ 4,085,436,198
(F) 前期繰越損益金	131,727,446,969
(G) 解約差損益金	△ 5,017,732,001
(H) 追加信託差損益金	22,090,304,444
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	144,714,583,214
次期繰越損益金(I)	144,714,583,214

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

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

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

運用報告書 第12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）

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの第12期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針	S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）
運 用 方 法	①主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ②組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。 ③保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
投 資 信 託 証 券 組 入 制 限	無制限

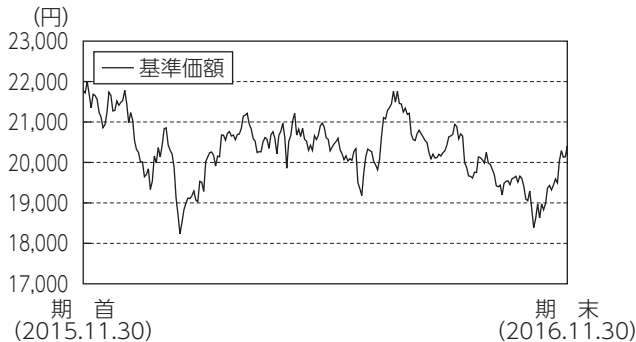
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本)		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	21,774	—	24,431	—	98.9	98.9
12月末	21,783	0.0	24,441	0.0	98.9	98.9
2016年1月末	20,429	△ 6.2	22,534	△ 7.8	98.4	98.4
2月末	19,512	△10.4	22,000	△ 9.9	99.0	99.0
3月末	21,168	△ 2.8	23,793	△ 2.6	98.4	98.4
4月末	20,619	△ 5.3	23,520	△ 3.7	98.9	98.9
5月末	20,972	△ 3.7	23,640	△ 3.2	98.9	98.9
6月末	20,140	△ 7.5	22,639	△ 7.3	98.7	98.7
7月末	21,341	△ 2.0	24,167	△ 1.1	99.0	99.0
8月末	20,634	△ 5.2	23,213	△ 5.0	99.0	99.0
9月末	19,981	△ 8.2	22,695	△ 7.1	99.2	99.2
10月末	19,054	△12.5	21,636	△11.4	99.1	99.1
(期末)2016年11月30日	20,411	△ 6.3	23,209	△ 5.0	98.9	98.9

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：21,774円 期末：20,411円 騰落率：△6.3%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市況は上昇しましたが、為替相場で米ドルをはじめほとんどの通貨に対して円高が進んだことから、ベンチマークであるS & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) が下落し、当ファンドの基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は、2016年1月に中国を中心とした株式市場の混乱を受けて一時下落した後、2月半ば以降は世界的な長期金利の低下を受けて堅調でした。しかし8月からは、米国の中心に長期金利が上昇に転じた影響でリートは売られました。

米国では、2016年に入ると、株式市況の下落や一部不動産関連指標の悪化を受けてリートは下落しました。2月中旬からは、米国の早期追加利上げ観測の後退や雇用統計などの経済指標が堅調だったことを受けて、米国リートは反発しました。4月からしばらくは米国の追加利上げ時期に関する思惑により米国リートは一進一

退の動きとなりましたが、6月からは市場予想を上回る経済指標の発表や米国リートの好調な決算が続き再び上昇しました。8月以降は、FRB (米国連邦準備制度理事会) 議長の発言などから米国の早期利上げ観測が強まったため長期金利が上昇したことなどが嫌気され、米国リートは軟調に推移して期末を迎えました。

欧州では、2016年年初から、ECB (欧州中央銀行) の追加金融緩和が予想を下回る規模であったことや金融機関の信用リスクに対する警戒感が悪材料となり、軟調に推移しました。欧州リート市況は、2月後半から、ECBの追加金融緩和策の発表などで長期金利が低下したことや好感されて上昇に転じました。その後5月以降は、英国のEU (欧州連合) 離脱問題が嫌気され上値が重い展開となりましたが、英国の国民投票でEU離脱派の勝利後は金融を中心に欧州大陸でのオフィス需要が高まるという見方で一時反発しました。期末にかけては、ECBの金融緩和策縮小観測もあり、欧州リートは売られました。英国リートは、EU離脱派の勝利によるオフィス需要の減少が懸念されたことから、6月以降は欧州大陸と比べてさえない動きとなりました。

アジアでは、香港は2016年1月に一時下落したものの、その後は中国政府の追加経済対策や深セン・香港コネクト (深センと香港証券取引所の相互取引制度) の開始が決定されることによる資金流入が期待されたことから、7月まで上昇を続けました。しかし期末にかけては、ボクス圏での推移となりました。シンガポールでは、2016年2月から長期金利の低下と相対的に高い配当利回りを受けて緩やかに上昇しましたが、10月以降は長期金利上昇を嫌気して下落基調に転じました。

オーストラリアでは、2016年1月中旬からRBA (オーストラリア準備銀行) に対する利下げ期待が根強いことや、相対的に堅調な国内景気に支えられる形で堅調に推移しました。しかし8月以降は、オーストラリアでも長期金利が上昇したことから、下落に転じました。

○為替相場

為替相場は、2016年前半を中心に円高基調でした。

米ドルは、2015年12月以降、原油価格の低下などによるリスク回避の動きを受けて米ドル安となりました。米国の早期追加利上げ観測の後退や期待に反して日銀が金融政策の現状維持を決定したことや、英国のEU離脱派の勝利も円高材料となりました。8月以降は、日銀の金融政策の手詰まり感もあったものの、米国の早期利上げ観測が強まったことから緩やかな米ドル高となり、11月初旬の米国大統領選挙以降は、日米長期金利差の拡大などにより米ドル高基調が強まりました。

ユーロおよび英ポンドは、欧州の信用不安が再燃したことや英国でEU離脱議論が高まったことが嫌気され、2016年に入ると、ユーロ安、英ポンド安となりました。実際に国民投票で英国のEU離脱派が勝利すると、ユーロは結果として下げ止まりましたが、英ポンドは英国経済への影響が懸念されたことからEU離脱派の勝利による急落後も、英ポンド安が進みました。11月初旬以降は、長期金利の高まりを受けてユーロ高、英ポンド高に振れました。

オーストラリア・ドルは、中国の景気悪化懸念やRBAの利下げなどで2016年6月まではオーストラリア・ドル安基調でしたが、7月以降は資源価格が上昇に転じたことや長期金利の上昇などもあり、ややオーストラリア・ドル高となりました。

◆前期における「今後の運用方針」

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。リートの組入比率は、期を通じて原則として97%以上で運用を行ないます。また、保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

◆ポートフォリオについて

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

具体的には、S & P先進国REIT指数採用銘柄全銘柄に投資しました。期末では、15カ国、320銘柄となっております。

◆ベンチマークとの差異について

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスのかい離要因となりました。

また、期を通じて、リート組入比率を基本的に97～99％台で推移させました。これは、ベンチマークの上昇時にはマイナスのかい離要因、ベンチマークの下落時にはプラスのかい離要因となります。

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

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

《今後の運用方針》

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

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

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	6円 (0)
(投資信託証券)	(6)
有価証券取引税 (株式)	7 (0)
(投資信託証券)	(7)
その他費用 (保管費用)	61 (55)
(その他)	(5)
合 計	73

(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)

外 国	ア メ リ カ	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
		百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル
		(1.56)	(2)	1.56	2

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

外 国	ア メ リ カ	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
		(△ 4.402)	(△ 229)	(4.6)	(177)
	カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
		(32.9)	(△ 610)	(2.8)	(30)
	オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
		(626.088)	(2,556)	(6)	(21)
		(0.6)	(1)	(1)	(1)
	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
		(216)	(3,453)	(10)	(22)
		(1)	(1)	(1)	(1)
	シンガポール	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
		(798)	(1,032)	(22.3)	(18)
		(14.201)	(3)	(1)	(1)
	ニュージーランド	千口	千ニュージーランド・ドル	千口	千ニュージーランド・ドル
		(117.792)	(166)	(1)	(1)
		(2.25)	(△ 0)	(1)	(1)
	イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
		(335.911)	(1,022)	(0.2)	(2)
		(3.439)	(4)	(1)	(1)
	イスラエル	千口	千イスラエル・シェケル	千口	千イスラエル・シェケル
		(2.69)	(31)	(1)	(1)
		(1)	(1)	(1)	(1)
	ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		(37.9)	(49)	(1)	(1)
		(1)	(1)	(1)	(1)
	ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		(5.196)	(104)	(0.05)	(1)
		(1)	(1)	(1)	(1)
	ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		(2.644)	(173)	(1)	(1)
		(1)	(△ 0)	(1)	(1)
	ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		(12.8)	(1,048)	(0.4)	(7)
		(△ 0.2)	(△ 6)	(1)	(1)
	ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		(4.266)	(45)	(1)	(1)
		(1)	(△ 1)	(1)	(1)
	ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		(22)	(220)	(1)	(1)
		(0.675)	(2)	(1)	(1)
	ユーロ (イタリア)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		(27.25)	(15)	(1)	(1)
		(1)	(△ 0)	(1)	(1)
	ユーロ (ユーロ 通貨計)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		(112.056)	(1,657)	(0.45)	(9)
		(0.475)	(△ 6)	(1)	(1)

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
投資信託証券

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘	柄	口 数	金 額	平均単価	銘	柄	口 数	金 額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		7.3	153,342	21,005	PUBLIC STORAGE (アメリカ)		0.1	2,628	26,280
PUBLIC STORAGE (アメリカ)		3.5	83,905	23,973	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		0.1	2,325	23,256
PROLOGIS INC (アメリカ)		12.1	64,679	5,345	MACERICH CO/THE (アメリカ)		0.2	1,789	8,945
WELLTOWER INC (アメリカ)		8.4	62,173	7,401	WELLTOWER INC (アメリカ)		0.2	1,589	7,948
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		3.2	59,234	18,510	BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)		0.1	1,505	15,054
VENTAS INC (アメリカ)		8.4	58,836	7,004	SL GREEN REALTY CORP (アメリカ)		0.1	1,420	14,207
UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)		2.2	58,267	26,485	MILESTONE APARTMENTS REAL ES (カナダ)		0.9	1,299	1,443
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		8.4	58,014	6,906	CAMPUS CREST COMMUNITIES INC (アメリカ)		1.3	1,030	792
BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)		3.6	49,084	13,634	INNVEST REAL ESTATE INVESTME (カナダ)		1.7	964	567
SCENTRE GROUP (オーストラリア)		119	42,501	357	EXTRA SPACE STORAGE INC (アメリカ)		0.1	959	9,590

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

ファンド名	当 期 末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド				
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
MANULIFE US REAL ESTATE INV	24.9	20	2,323	0.0
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3.1	87	9,876	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	3.6	36	4,103	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	3.982	108	12,247	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	4.8	83	9,400	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6.2	1,021	114,838	2.2
SIMON PROPERTY GROUP INC	14.147	2,578	289,930	5.5
BOSTON PROPERTIES INC	6.9	864	97,163	1.9
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	6.955	292	32,878	0.6
GENERAL GROWTH PROPERTIES	26.277	674	75,801	1.4
VORNADO REALTY TRUST	7.764	769	86,497	1.7
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	7.2	75	8,490	0.2
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	0.9	17	1,968	0.0
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1.6	33	3,739	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.6	12	1,383	0.0
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	3.769	90	10,207	0.2
QTS REALTY TRUST INC-CL A	2.1	100	11,294	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	16.5	998	112,204	2.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	6.8	127	14,364	0.3
EPR PROPERTIES	2.8	198	22,292	0.4
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	0.6	7	883	0.0
CITY OFFICE REIT INC	0.7	8	992	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	7.5	58	6,610	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	2.629	51	5,810	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	1.7	33	3,734	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	2.5	58	6,579	0.1

ファンド名	当 期 末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	0.9	42	4,823	0.1
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2.3	133	14,958	0.3
FOREST CITY REALTY TRUST-A	9.4	176	19,803	0.4
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4.7	98	11,069	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	0.5	11	1,256	0.0
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	0.813	10	1,150	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	33.4	577	64,958	1.2
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	9.808	207	23,276	0.4
GRAMERCY PROPERTY TRUST	18.287	167	18,872	0.4
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	3.3	139	15,663	0.3
CORESITE REALTY CORP	1.5	106	12,013	0.2
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	4.6	160	18,068	0.3
RLJ LODGING TRUST	5.4	121	13,689	0.3
FARMLAND PARTNERS INC	0.5	5	665	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	5.9	109	12,290	0.2
ARMADA HOFFER PROPERTIES IN	1.5	21	2,455	0.0
CYRUSONE INC	3.2	141	15,857	0.3
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	1.4	24	2,747	0.1
KIMCO REALTY CORP	18.9	492	55,328	1.1
HEALTHCARE TRUST OF AWE-CL A	6.15	177	19,987	0.4
WHITESTONE REIT	1	13	1,527	0.0
TIER REIT INC	2.1	33	3,808	0.1
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	1.9	3	352	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	8.6	267	30,077	0.6
PARKWAY INC	1.788	33	3,813	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	6.3	124	14,002	0.3
COLONY STARWOOD HOMES	2.2	66	7,446	0.1
QUALITY CARE PROPERTIES	4.1	60	6,784	0.1

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ファンド名	当期末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
WASHINGTON PRIME GROUP INC	8.06	83	9,432	0.2
CORECIVIC INC	5.224	116	13,078	0.3
STORE CAPITAL CORP	6.9	173	19,539	0.4
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3.9	55	6,243	0.1
LIFE STORAGE INC	2.1	172	19,401	0.4
SELECT INCOME REIT	2.8	70	7,960	0.2
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1.8	73	8,229	0.2
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	2.782	24	2,727	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	1	13	1,571	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	5.4	109	12,287	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	2.7	60	6,814	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	5.3	112	12,631	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	3.4	81	9,116	0.2
VENTAS INC	15.779	963	108,330	2.1
CARETRUST REIT INC	2.603	37	4,228	0.1
NEW YORK REIT INC	7.2	70	7,924	0.2
GEO GROUP INC/THE	3.3	109	12,338	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	11.5	288	32,411	0.6
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	3.2	60	6,856	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	2.7	60	6,820	0.1
UMH PROPERTIES INC	1	13	1,496	0.0
IRON MOUNTAIN INC	10.9	367	41,331	0.8
TERRENO REALTY CORP	2	54	6,102	0.1
VEREIT INC	42.908	365	41,098	0.8
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	21.3	236	26,603	0.5
SUN COMMUNITIES INC	3	220	24,734	0.5
ACADIA REALTY TRUST	3.411	114	12,826	0.2
ALEXANDER'S INC	0.2	85	9,559	0.2
PROLOGIS INC	23.746	1,221	137,320	2.6
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3.5	391	43,958	0.8
BRANDYWINE REALTY TRUST	7.6	117	13,251	0.3
SAUL CENTERS INC	0.5	32	3,623	0.1
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7.645	91	10,304	0.2
MACK-CALI REALTY CORP	4	108	12,249	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	3.9	309	34,750	0.7
COUSINS PROPERTIES INC	14.807	119	13,416	0.3
DDR CORP	13.656	208	23,427	0.4
DUKE REALTY CORP	15.8	407	45,844	0.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	1.5	103	11,635	0.2
EQUITY ONE INC	4	119	13,458	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2.967	640	72,003	1.4
FELCOR LODGING TRUST INC	5.6	39	4,488	0.1
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5.1	136	15,388	0.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3.2	453	51,011	1.0
GETTY REALTY CORP	1.103	26	2,990	0.1
WELLTOWER INC	16.1	1,033	116,181	2.2
HCP INC	21.1	624	70,213	1.3
HIGHWOODS PROPERTIES INC	4.3	209	23,522	0.4
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	7.3	214	24,168	0.5
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5.2	155	17,479	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	5.475	160	18,040	0.3
KILROY REALTY CORP	4.2	309	34,774	0.7
LASALLE HOTEL PROPERTIES	4.9	134	15,121	0.3

ファンド名	当期末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
LIBERTY PROPERTY TRUST	6.6	262	29,478	0.6
LTC PROPERTIES INC	1.8	83	9,387	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	9.4	98	11,116	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,424	321	36,109	0.7
MACERICH CO/THE	5.4	373	41,978	0.8
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3.6	254	28,596	0.5
NATL HEALTH INVESTORS INC	1.7	123	13,890	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6.6	283	31,897	0.6
REALTY INCOME CORP	11,517	653	73,463	1.4
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4.1	119	13,449	0.3
PENN REAL ESTATE INVEST TST	3.1	59	6,649	0.1
POST PROPERTIES INC	2.4	159	17,950	0.3
PUBLIC STORAGE	6.7	1,404	157,881	3.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	0.9	102	11,476	0.2
REGENCY CENTERS CORP	4.6	307	34,596	0.7
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	3.5	60	6,795	0.1
ISTAR INC	3.2	40	4,532	0.1
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	4.2	147	16,558	0.3
SL GREEN REALTY CORP	4.5	477	53,639	1.0
SENIOR HOUSING PROP TRUST	10.6	193	21,795	0.4
TAUBMAN CENTERS INC	2.7	199	22,391	0.4
URSTADT BIDDLE - CLASS A	1.2	27	3,129	0.1
UDR INC	11.9	406	45,739	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.6	36	4,069	0.1
WP CAREY INC	4.7	279	31,406	0.6
WASHINGTON REIT	3.3	103	11,608	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	5.1	182	20,468	0.4
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	3.1	21	2,401	0.0
AGREE REALTY CORP	1	45	5,111	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8.65	256	28,793	0.6
CUBESMART	7.8	193	21,746	0.4
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	9,426	136	15,354	0.3
DIGITAL REALTY TRUST INC	7.2	673	75,681	1.4
CEDAR REALTY TRUST INC	2.9	19	2,148	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	5.6	396	44,603	0.9
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	2.2	21	2,431	0.0
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,775	35	4,000	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	4.7	30	3,418	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	3.75	91	10,320	0.2
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	3	43	4,920	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.5	12	1,386	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	5.8	275	30,945	0.6
EDUCATION REALTY TRUST INC	3.2	131	14,756	0.3
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1.1	21	2,406	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	8,742	91	10,250	0.2
NORTHSTAR REALTY FINANCE	7.85	120	13,493	0.3
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,649	28	3,213	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	13.9	169	19,032	0.4
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	4.7	59	6,742	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	6.4	238	26,786	0.5
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	4.1	190	21,368	0.4
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	10.3	159	17,936	0.3
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	954,218 159銘柄	33,730 3,791,999	<72.5%>

ファンド名	当 期 末			
	口数	価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	3.2	37	3,146	0.1
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	2.6	23	1,986	0.0
SLATE RETAIL REIT - U	0.5	7	597	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1.5	18	1,518	0.0
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE	0.4	4	356	0.0
SLATE OFFICE REIT	0.6	4	392	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	1.3	12	1,061	0.0
BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	0.5	12	1,072	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1	44	3,685	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	1.1	8	710	0.0
ONEREIT	1	3	293	0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1.3	9	788	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	1.9	25	2,117	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	5.2	27	2,297	0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	0.4	5	459	0.0
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	1.8	33	2,763	0.1
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1.4	21	1,813	0.0
PLAZA RETAIL REIT	1.7	8	711	0.0
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	2.7	85	7,114	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTATE	2.9	89	7,471	0.1
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	1.6	72	6,094	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	3.79	53	4,455	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	6.166	134	11,243	0.2
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	1	13	1,166	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7.1	191	16,011	0.3
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2.3	41	3,460	0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1	44	3,694	0.1
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1	18	1,581	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1.9	26	2,195	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1.8	61	5,155	0.1
カナダ・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	60,656 30銘柄	1,140 95,421	< 1.8%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	9	21	1,802	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	56.5	51	4,373	0.1
GENERATION HEALTHCARE REIT	5.5	9	793	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	31	65	5,503	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	8.5	25	2,167	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	21	31	2,676	0.1
INDUSTRIA REIT	6.5	13	1,115	0.0
GDI PROPERTY GROUP	21	20	1,722	0.0
360 CAPITAL OFFICE FUND	2.5	5	458	0.0
SCENTRE GROUP	237	997	83,952	1.6
ARENA REIT	10	17	1,510	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	6.5	17	1,487	0.0
BWP TRUST	21	59	5,035	0.1
DEXUS PROPERTY GROUP	42.5	383	32,255	0.6
GPT GROUP	79.5	376	31,639	0.6
INVESTA OFFICE FUND	27.5	117	9,903	0.2
CHARTER HALL RETAIL REIT	14.5	60	5,124	0.1
MIRVAC GROUP	163.5	333	28,064	0.5
STOCKLAND	105	450	37,900	0.7

ファンド名	当 期 末			
	口数	価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
WESTFIELD CORP	85	775	65,225	1.2
ABACUS PROPERTY GROUP	12	35	2,958	0.1
GOODMAN GROUP	70	459	38,695	0.7
VICINITY CENTRES	144.5	411	34,650	0.7
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	2.5	16	1,396	0.0
CHARTER HALL GROUP	18	81	6,830	0.1
ALE PROPERTY GROUP	7.5	32	2,700	0.1
ASPEN GROUP	3	3	257	0.0
INGENIA COMMUNITIES GROUP	8	21	1,837	0.0
360 CAPITAL GROUP LTD	5.5	4	414	0.0
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	1,224.5 29銘柄	4,902 412,455	< 7.9%>
(香港)	千口	千香港ドル	千円	%
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	43	184	2,668	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	44	202	2,934	0.1
FORTUNE REIT	59	525	7,622	0.1
PROSPERITY REIT	48	149	2,164	0.0
LINK REIT	100	5,290	76,705	1.5
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	34	108	1,577	0.0
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	29	59	862	0.0
CHAMPION REIT	93	409	5,933	0.1
香港・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	450 8銘柄	6,928 100,468	< 1.9%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	35.028	42	3,333	0.1
FIRST REAL ESTATE INVST TRUST	21	26	2,114	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	79.2	76	6,004	0.1
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	22.5	28	2,221	0.0
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	45	41	3,251	0.1
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	94.7	142	11,255	0.2
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	103.3	238	18,844	0.4
CAPITALAND MALL TRUST	119	227	17,949	0.3
SUNTEC REIT	112	187	14,814	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	65.8	65	5,170	0.1
KEPPEL REIT	76.5	80	6,343	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	23.26	29	2,341	0.0
ASCOTT RESIDENCE TRUST	40	45	3,569	0.1
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	47.479	25	1,987	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS	29.2	38	3,043	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	24.7	47	3,774	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	58.5	44	3,487	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	30	41	3,257	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	16.8	39	3,157	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	76.6	28	2,238	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	51.48	82	6,504	0.1
CACHE LOGISTICS TRUST	34.7	27	2,205	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	77	110	8,725	0.2
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	35.8	20	1,625	0.0
SPH REIT	30.7	29	2,303	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	30.6	19	1,546	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	22.9	12	949	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	35.5	24	1,948	0.0

ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド

ファンド名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
OUE HOSPITALITY TRUST OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	千口 46.673 17.45	千シンガポール・ドル 29 11	千円 2,358 930	% 0.0 0.0
シンガポール・ ドル 通 貨 計	口数、金額 30銘柄数<比率>	1,503.37 30銘柄	1,864 147,257	< 2.8%>
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ ドル	千円	%
STRIDE PROPERTY GROUP	15	28	2,251	0.0
INVESTORE PROPERTY LTD	7.75	11	889	0.0
ARGOSY PROPERTY LTD	33	34	2,793	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	55.5	79	6,413	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	18.5	28	2,301	0.0
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	14	28	2,291	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	43.5	54	4,346	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	44.5	53	4,285	0.1
ニュージーランド・ ドル 通 貨 計	口数、金額 8銘柄数<比率>	231.75 8銘柄	318 25,572	< 0.5%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	70.7	41	5,834	0.1
MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	2.55	11	1,665	0.0
CAPITAL & REGIONAL PLC	20.65	11	1,588	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	20.6	22	3,182	0.1
REGIONAL REIT LTD	6.65	7	1,018	0.0
NEW RIVER REIT PLC	10.1	33	4,759	0.1
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	54.65	20	2,832	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	35.6	347	48,753	0.9
HANSTEEN HOLDINGS PLC	32.2	34	4,785	0.1
SEGRO PLC	36.6	153	21,519	0.4
HAMMERSON PLC	34.65	190	26,768	0.5
BRITISH LAND CO PLC	45.2	271	38,092	0.7
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	15.2	92	12,927	0.2
INTU PROPERTIES PLC	39.8	108	15,183	0.3
DERWENT LONDON PLC	4.9	117	16,497	0.3
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	25.85	28	4,021	0.1
WORKSPACE GROUP PLC	5.1	35	4,964	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	9.15	31	4,433	0.1
SHAFTESBURY PLC	12.3	112	15,799	0.3
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	3.3	5	838	0.0
BIG YELLOW GROUP PLC	6.4	42	6,013	0.1
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	27.2	39	5,570	0.1
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	22.45	13	1,836	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	47.85	63	8,851	0.2
イギリス・ ポンド通貨計	口数、金額 24銘柄数<比率>	589.65 24銘柄	1,834 257,738	< 4.9%>
(イスラエル)	千口	千イスラエル・シケル	千円	%
REIT 1 LTD	5.79	65	1,918	0.0
イスラエル・ シケル通貨計	口数、金額 1銘柄数<比率>	5.79 1銘柄	65 1,918	< 0.0%>
ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	15.15	17	2,103	0.0
GREEN REIT PLC	29.5	36	4,413	0.1
HIBERNIA REIT PLC	30.3	35	4,297	0.1
国 小 計	口数、金額 3銘柄数<比率>	74.95 3銘柄	90 10,815	< 0.2%>

ファンド名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千円	%
WERELDHAVE NV	1.75	69	8,372	0.2
EUROCOMMERCIAL PROPRIET-CV	2.1	72	8,672	0.2
NSI NV	5.75	20	2,415	0.0
VASTNED RETAIL NV	0.8	27	3,323	0.1
国 小 計	口数、金額 4銘柄数<比率>	10.4 4銘柄	190 22,784	< 0.4%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千円	%
AEDIFICA	0.6	41	4,962	0.1
COFINIMMO	0.9	94	11,284	0.2
BEFIMMO	1	52	6,256	0.1
INTEREST OFFICES&WAREHOUSES	0.55	12	1,520	0.0
RETAIL ESTATES	0.25	18	2,210	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA	0.7	56	6,731	0.1
WERELDHAVE BELGIUM NV	0.1	10	1,304	0.0
XIOR STUDENT HOUSING NV	0.15	5	630	0.0
MONTEA	0.25	10	1,287	0.0
国 小 計	口数、金額 9銘柄数<比率>	4.5 9銘柄	302 36,189	< 0.7%>
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO SE	4.4	927	111,076	2.1
ICADE	2	129	15,508	0.3
ALTAREA	0.1	17	2,106	0.0
GECINA SA	1.8	221	26,512	0.5
KLEPIERRE	9.25	326	39,140	0.7
FONCIERE DES REGIONS	2.2	162	19,500	0.4
MERCIALYS	2.4	43	5,257	0.1
国 小 計	口数、金額 7銘柄数<比率>	22.15 7銘柄	1,830 219,102	< 4.2%>
ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4.45	51	6,221	0.1
HAMBORNER REIT AG	3.45	29	3,557	0.1
国 小 計	口数、金額 2銘柄数<比率>	7.9 2銘柄	81 9,778	< 0.2%>
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	4	28	3,370	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	4.7	50	6,081	0.1
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	2.55	33	3,995	0.1
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	20.75	197	23,598	0.5
国 小 計	口数、金額 4銘柄数<比率>	32 4銘柄	309 37,046	< 0.7%>
ユーロ (イタリア)	千口	千ユーロ	千円	%
BENI STABILI SPA	45.35	22	2,701	0.1
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBU	11.9	7	891	0.0
国 小 計	口数、金額 2銘柄数<比率>	57.25 2銘柄	30 3,593	< 0.1%>
ユーロ通貨計	口数、金額 31銘柄数<比率>	209.15 31銘柄	2,834 339,309	< 6.5%>
合 計	口数、金額 320銘柄数<比率>	5,229.084 320銘柄	- 5,172,139	< 98.9%>

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

(注2) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■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	%
投資信託証券	5,172,139	98.1
コール・ローン等、その他	102,792	1.9
投資信託財産総額	5,274,931	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝112.42円、1カナダ・ドル＝83.68円、1オーストラリア・ドル＝84.14円、1香港ドル＝14.50円、1シンガポール・ドル＝78.97円、1ニュージーランド・ドル＝80.25円、1イギリス・ポンド＝140.46円、1イスラエル・シェケル＝29.32円、1ユーロ＝119.70円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産（5,171,658千円）の投資信託財産総額（5,274,931千円）に対する比率は、98.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	5,291,792,695円
コール・ローン等	94,523,614
投資信託証券(評価額)	5,172,139,723
未収入金	16,957,475
未収配当金	8,171,883
(B) 負債	60,415,723
未払金	50,014,066
未払解約金	9,744,000
その他未払費用	657,657
(C) 純資産総額(A－B)	5,231,376,972
元本	2,563,048,197
次期繰越損益金	2,668,328,775
(D) 受益権総口数	2,563,048,197口
1万口当り基準価額(C／D)	20,411円

* 期首における元本額は1,271,978,733円、当期中における追加設定元本額は1,361,526,489円、同解約元本額は70,457,025円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）825,263,014円、ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）75,812,669円、Ｄ－Ｉ's グローバルＲＥＩＴインデックス1,488,344円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 23,511円、iFree 外国ＲＥＩＴインデックス38,800,747円、iFree 8資産バランス30,296,829円、ＤＣダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスファンド1,282,593,048円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 4,056,551円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 5,867,167円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 946,555円、ダイワ・インデックスセレクト グローバルＲＥＩＴ280,634,605円、ダイワ・ノーロード グローバルＲＥＩＴファンド17,265,157円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は20,411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	125,276,027円
受取配当金	125,272,652
受取利息	10,988
その他収益金	3,756
支払利息	△ 11,369
(B) 有価証券売買損益	△ 194,058,653
売買益	137,023,240
売買損	△ 331,081,893
(C) その他費用	△ 9,680,746
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 78,463,372
(E) 前期繰越損益金	1,497,624,611
(F) 解約差損益金	△ 73,034,975
(G) 追加信託差損益金	1,322,202,511
(H) 合計(D + E + F + G)	2,668,328,775
次期繰越損益金(H)	2,668,328,775

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

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

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

運用報告書 第12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）

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の第12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NOMUR A－B P I 総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。）
運 用 方 法	①主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（NOMUR A－B P I 総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。 ②運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

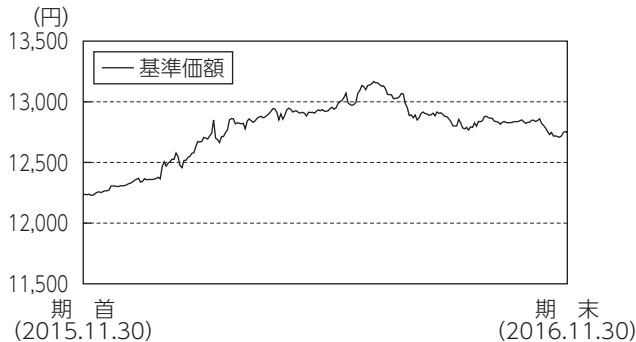
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総 合 指 数		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2015年11月30日	12,236	—	12,250	—	96.9	—
12月末	12,310	0.6	12,326	0.6	99.0	—
2016年1月末	12,466	1.9	12,482	1.9	98.0	—
2月末	12,673	3.6	12,692	3.6	97.7	—
3月末	12,777	4.4	12,795	4.5	99.2	—
4月末	12,888	5.3	12,907	5.4	97.7	—
5月末	12,936	5.7	12,952	5.7	97.2	—
6月末	13,100	7.1	13,111	7.0	98.6	—
7月末	12,985	6.1	13,007	6.2	99.1	—
8月末	12,860	5.1	12,873	5.1	99.3	—
9月末	12,869	5.2	12,882	5.2	99.3	—
10月末	12,831	4.9	12,847	4.9	98.5	—
(期末)2016年11月30日	12,749	4.2	12,764	4.2	97.0	—

(注1) 騰落率は期首比。

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

(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：12,236円 期末：12,749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り債券価格が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○国内債券市況

国内長期金利は、2016年1月下旬に日銀がマイナス金利政策を導入したことを受け、2月にかけて大きく低下しました。その後、市場の追加金融緩和観測が根強かったことや、英国の国民投票でE

U（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」

ベンチマーク（NOMURA-BPI総合指数）との高い連動性を維持するように運用を行なっておりまます。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、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行ないまます。なお、当ファンドは現在、NOMURA-BPI総合指数に含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

◆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ます。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レージション、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ます。

◆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》

ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行なっておりまます。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、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行ないまます。なお、NOMURA-BPI総合指数に含まれる債券のうち、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ 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 国債証券	3,805,658	2,726,492 (－)
地方債証券	100,333	620,871 (－)
内 特殊債券	103,989	558,994 (－)
社債券	401,942	606,719 (－)

(注 1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

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

(注 3) 社債券には新株予約権付社債券（転換社債券）は含まれておりません。

(注 4) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

公 社 債

(2015年12月 1 日から2016年11月30日まで)

当			期		
買 付			売 付		
銘	柄 金 額		銘	柄 金 額	
	千円			千円	
127 5年国債 0.1% 2021/3/20	242,844	363 2年国債 0.1% 2018/4/15	213,349		
363 2年国債 0.1% 2018/4/15	213,435	360 2年国債 0.1% 2018/1/15	160,826		
342 10年国債 0.1% 2026/3/20	186,575	340 10年国債 0.4% 2025/9/20	156,831		
340 10年国債 0.4% 2025/9/20	181,798	125 5年国債 0.1% 2020/9/20	152,906		
125 5年国債 0.1% 2020/9/20	170,517	342 10年国債 0.1% 2026/3/20	146,136		
341 10年国債 0.3% 2025/12/20	161,001	335 10年国債 0.5% 2024/9/20	137,052		
360 2年国債 0.1% 2018/1/15	160,593	122 5年国債 0.1% 2019/12/20	136,599		
343 10年国債 0.1% 2026/6/20	155,916	19-1 広島県公債 1.78% 2017/5/25	112,943		
128 5年国債 0.1% 2021/6/20	149,414	19-2 静岡県公債 1.93% 2017/6/28	102,133		
126 5年国債 0.1% 2020/12/20	125,619	28 公営企業 1.89% 2017/10/25	102,036		

(注 1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注 2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

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

作 成 期	当 期 末				
区 分	額面金額	評 価 額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率
	千円	千円	%	%	%
国債証券	10,012,000	11,327,843	76.2	－	56.6
地方債証券	1,200,000	1,237,940	8.3	－	2.8
特殊債券 (除く金融債券)	900,000	926,951	6.2	－	1.4
普通社債券	900,000	917,180	6.2	－	5.5
合 計	13,012,000	14,409,916	97.0	－	60.8

(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）

当 期 末			期 末		
区 分	銘 柄	年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
国債証券	362 2年国債	0.1000	124,000	124,502	2018/03/15
	364 2年国債	0.1000	20,000	20,087	2018/05/15
	365 2年国債	0.1000	53,000	53,232	2018/06/15
	366 2年国債	0.1000	80,000	80,362	2018/07/15
	368 2年国債	0.1000	120,000	120,601	2018/09/15
	114 5年国債	0.3000	62,000	62,548	2018/09/20
	296 10年国債	1.5000	35,000	36,061	2018/09/20
	40 20年国債	2.3000	51,000	53,288	2018/09/20
	116 5年国債	0.2000	133,000	134,025	2018/12/20
	297 10年国債	1.4000	20,000	20,645	2018/12/20
	298 10年国債	1.3000	61,000	62,844	2018/12/20
	300 10年国債	1.5000	8,000	8,306	2019/03/20
	41 20年国債	1.5000	40,000	41,539	2019/03/20
	42 20年国債	2.6000	22,000	23,404	2019/03/20
	119 5年国債	0.1000	21,000	21,142	2019/06/20
	301 10年国債	1.5000	35,000	36,486	2019/06/20
	302 10年国債	1.4000	54,000	56,155	2019/06/20
	120 5年国債	0.2000	10,000	10,099	2019/09/20
	121 5年国債	0.1000	25,000	25,179	2019/09/20
	43 20年国債	2.9000	14,000	15,202	2019/09/20
	122 5年国債	0.1000	15,000	15,112	2019/12/20
	305 10年国債	1.3000	100,000	104,409	2019/12/20
	123 5年国債	0.1000	80,000	80,621	2020/03/20
	306 10年国債	1.4000	10,000	10,508	2020/03/20
	44 20年国債	2.5000	32,000	34,785	2020/03/20
	45 20年国債	2.4000	20,000	21,674	2020/03/20
	124 5年国債	0.1000	110,000	110,881	2020/06/20
	308 10年国債	1.3000	100,000	105,078	2020/06/20
	309 10年国債	1.1000	103,000	107,495	2020/06/20
	46 20年国債	2.2000	19,000	20,573	2020/06/22
	125 5年国債	0.1000	138,000	139,157	2020/09/20
	310 10年国債	1.0000	30,000	31,276	2020/09/20
	311 10年国債	0.8000	42,000	43,466	2020/09/20
	47 20年国債	2.2000	23,000	25,033	2020/09/21

当		期		末		
区 分	銘 柄	年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日	
		%	千円	千円		
	126 5年国債	0.1000	124,000	125,083	2020/12/20	
	312 10年国債	1.2000	94,000	99,008	2020/12/20	
	48 20年国債	2.5000	9,000	9,956	2020/12/21	
	127 5年国債	0.1000	159,000	160,440	2021/03/20	
	313 10年国債	1.3000	75,000	79,563	2021/03/20	
	314 10年国債	1.1000	77,000	81,020	2021/03/20	
	49 20年国債	2.1000	4,000	4,381	2021/03/22	
	50 20年国債	1.9000	30,000	32,598	2021/03/22	
	128 5年国債	0.1000	147,000	148,375	2021/06/20	
	315 10年国債	1.2000	90,000	95,345	2021/06/20	
	316 10年国債	1.1000	56,000	59,069	2021/06/20	
	51 20年国債	2.0000	25,000	27,387	2021/06/21	
	129 5年国債	0.1000	35,000	35,345	2021/09/20	
	317 10年国債	1.1000	40,000	42,304	2021/09/20	
	318 10年国債	1.0000	33,000	34,742	2021/09/20	
	52 20年国債	2.1000	19,000	21,012	2021/09/21	
	319 10年国債	1.1000	129,000	136,821	2021/12/20	
	320 10年国債	1.0000	35,000	36,944	2021/12/20	
	53 20年国債	2.1000	13,000	14,451	2021/12/20	
	54 20年国債	2.2000	14,000	15,634	2021/12/20	
	321 10年国債	1.0000	65,000	68,770	2022/03/20	
	322 10年国債	0.9000	73,000	76,845	2022/03/20	
	55 20年国債	2.0000	41,000	45,549	2022/03/21	
	323 10年国債	0.9000	60,000	63,294	2022/06/20	
	324 10年国債	0.8000	88,000	92,341	2022/06/20	
	56 20年国債	2.0000	12,000	13,398	2022/06/20	
	57 20年国債	1.9000	24,000	26,655	2022/06/20	
	325 10年国債	0.8000	127,000	133,550	2022/09/20	
	58 20年国債	1.9000	35,000	39,060	2022/09/20	
	59 20年国債	1.7000	3,000	3,326	2022/12/20	
	328 10年国債	0.6000	30,000	31,290	2023/03/20	
	61 20年国債	1.0000	40,000	42,760	2023/03/20	
	329 10年国債	0.8000	45,000	47,590	2023/06/20	
	62 20年国債	0.8000	16,000	16,921	2023/06/20	
	63 20年国債	1.8000	30,000	33,690	2023/06/20	
	330 10年国債	0.8000	81,000	85,814	2023/09/20	
	331 10年国債	0.6000	63,000	65,883	2023/09/20	
	64 20年国債	1.9000	35,000	39,697	2023/09/20	
	332 10年国債	0.6000	118,000	123,512	2023/12/20	
	65 20年国債	1.9000	42,000	47,827	2023/12/20	
	66 20年国債	1.8000	30,000	33,950	2023/12/20	
	333 10年国債	0.6000	153,000	160,281	2024/03/20	
	67 20年国債	1.9000	19,000	21,705	2024/03/20	
	68 20年国債	2.2000	25,000	29,108	2024/03/20	
	69 20年国債	2.1000	12,000	13,884	2024/03/20	
	334 10年国債	0.6000	156,000	163,558	2024/06/20	
	70 20年国債	2.4000	18,000	21,324	2024/06/20	
	71 20年国債	2.2000	17,000	19,882	2024/06/20	
	335 10年国債	0.5000	22,000	22,920	2024/09/20	
	72 20年国債	2.1000	53,000	61,849	2024/09/20	
	336 10年国債	0.5000	48,000	50,052	2024/12/20	
	337 10年国債	0.3000	65,000	66,730	2024/12/20	
	73 20年国債	2.0000	30,000	34,913	2024/12/20	

当		期		末		
区 分	銘 柄	年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日	
		%	千円	千円		
	74 20年国債	2.1000	22,000	25,780	2024/12/20	
	338 10年国債	0.4000	145,000	150,122	2025/03/20	
	75 20年国債	2.1000	14,000	16,466	2025/03/20	
	76 20年国債	1.9000	25,000	28,988	2025/03/20	
	339 10年国債	0.4000	137,000	141,864	2025/06/20	
	78 20年国債	1.9000	17,000	19,794	2025/06/20	
	79 20年国債	2.0000	14,000	16,421	2025/06/20	
	80 20年国債	2.1000	20,000	23,630	2025/06/20	
	340 10年国債	0.4000	135,000	139,874	2025/09/20	
	81 20年国債	2.0000	39,000	45,924	2025/09/20	
	82 20年国債	2.1000	28,000	33,218	2025/09/20	
	341 10年国債	0.3000	136,000	139,754	2025/12/20	
	83 20年国債	2.1000	25,000	29,777	2025/12/20	
	84 20年国債	2.0000	27,000	31,915	2025/12/20	
	342 10年国債	0.1000	40,000	40,371	2026/03/20	
	85 20年国債	2.1000	31,000	37,068	2026/03/20	
	86 20年国債	2.3000	6,000	7,286	2026/03/20	
	87 20年国債	2.2000	20,000	24,101	2026/03/20	
	343 10年国債	0.1000	152,000	153,377	2026/06/20	
	88 20年国債	2.3000	33,000	40,227	2026/06/20	
	89 20年国債	2.2000	15,000	18,142	2026/06/20	
	344 10年国債	0.1000	90,000	90,747	2026/09/20	
	90 20年国債	2.2000	37,000	44,910	2026/09/20	
	91 20年国債	2.3000	12,000	14,683	2026/09/20	
	92 20年国債	2.1000	45,000	54,360	2026/12/20	
	93 20年国債	2.0000	18,000	21,639	2027/03/20	
	94 20年国債	2.1000	29,000	35,161	2027/03/20	
	95 20年国債	2.3000	30,000	37,121	2027/06/20	
	96 20年国債	2.1000	23,000	27,976	2027/06/20	
	97 20年国債	2.2000	25,000	30,790	2027/09/20	
	98 20年国債	2.1000	29,000	35,404	2027/09/20	
	99 20年国債	2.1000	43,000	52,657	2027/12/20	
	100 20年国債	2.2000	35,000	43,403	2028/03/20	
	101 20年国債	2.4000	18,000	22,725	2028/03/20	
	102 20年国債	2.4000	10,000	12,669	2028/06/20	
	103 20年国債	2.3000	21,000	26,364	2028/06/20	
	104 20年国債	2.1000	24,000	29,580	2028/06/20	
	105 20年国債	2.1000	38,000	47,000	2028/09/20	
	106 20年国債	2.2000	16,000	19,976	2028/09/20	
	107 20年国債	2.1000	43,000	53,366	2028/12/20	
	108 20年国債	1.9000	43,000	52,339	2028/12/20	
	109 20年国債	1.9000	35,000	42,703	2029/03/20	
	110 20年国債	2.1000	16,000	19,911	2029/03/20	
	111 20年国債	2.2000	35,000	44,135	2029/06/20	
	112 20年国債	2.1000	29,000	36,209	2029/06/20	
	113 20年国債	2.1000	66,000	82,630	2029/09/20	
	114 20年国債	2.1000	45,000	56,483	2029/12/20	
	115 20年国債	2.2000	22,000	27,897	2029/12/20	
	2 30年国債	2.4000	9,000	11,670	2030/02/20	
	116 20年国債	2.2000	27,000	34,326	2030/03/20	
	117 20年国債	2.1000	37,000	46,557	2030/03/20	
	3 30年国債	2.3000	4,000	5,151	2030/05/20	
	118 20年国債	2.0000	13,000	16,225	2030/06/20	

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

当		期		末			
区	分	銘	柄	年利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
				%	千円	千円	
	119	20年国債		1.8000	13,000	15,879	2030/06/20
	120	20年国債		1.6000	50,000	59,745	2030/06/20
	121	20年国債		1.9000	56,000	69,296	2030/09/20
	122	20年国債		1.8000	10,000	12,239	2030/09/20
	4	30年国債		2.9000	8,000	11,024	2030/11/20
	123	20年国債		2.1000	42,000	53,268	2030/12/20
	124	20年国債		2.0000	25,000	31,363	2030/12/20
	125	20年国債		2.2000	25,000	32,127	2031/03/20
	126	20年国債		2.0000	21,000	26,400	2031/03/20
	127	20年国債		1.9000	18,000	22,377	2031/03/20
	5	30年国債		2.2000	8,000	10,299	2031/05/20
	128	20年国債		1.9000	32,000	39,859	2031/06/20
	129	20年国債		1.8000	28,000	34,479	2031/06/20
	130	20年国債		1.8000	28,000	34,538	2031/09/20
	131	20年国債		1.7000	33,000	40,230	2031/09/20
	6	30年国債		2.4000	9,000	11,911	2031/11/20
	132	20年国債		1.7000	25,000	30,523	2031/12/20
	133	20年国債		1.8000	40,000	49,422	2031/12/20
	134	20年国債		1.8000	25,000	30,936	2032/03/20
	135	20年国債		1.7000	20,000	24,452	2032/03/20
	136	20年国債		1.6000	20,000	24,155	2032/03/20
	7	30年国債		2.3000	12,000	15,779	2032/05/20
	137	20年国債		1.7000	18,000	22,037	2032/06/20
	138	20年国債		1.5000	24,000	28,661	2032/06/20
	139	20年国債		1.6000	32,000	38,696	2032/06/20
	140	20年国債		1.7000	65,000	79,688	2032/09/20
	8	30年国債		1.8000	5,000	6,214	2032/11/22
	9	30年国債		1.4000	11,000	12,991	2032/12/20
	141	20年国債		1.7000	48,000	58,875	2032/12/20
	142	20年国債		1.8000	20,000	24,840	2032/12/20
	10	30年国債		1.1000	15,000	16,996	2033/03/20
	143	20年国債		1.6000	48,000	58,191	2033/03/20
	144	20年国債		1.5000	24,000	28,719	2033/03/20
	11	30年国債		1.7000	9,000	11,073	2033/06/20
	145	20年国債		1.7000	65,000	79,912	2033/06/20
	12	30年国債		2.1000	11,000	14,257	2033/09/20
	146	20年国債		1.7000	62,000	76,248	2033/09/20
	13	30年国債		2.0000	11,000	14,101	2033/12/20
	147	20年国債		1.6000	64,000	77,683	2033/12/20
	14	30年国債		2.4000	22,000	29,694	2034/03/20
	148	20年国債		1.5000	59,000	70,641	2034/03/20
	15	30年国債		2.5000	21,000	28,749	2034/06/20
	149	20年国債		1.5000	63,000	75,414	2034/06/20
	16	30年国債		2.5000	26,000	35,635	2034/09/20
	150	20年国債		1.4000	53,000	62,586	2034/09/20
	17	30年国債		2.4000	17,000	23,053	2034/12/20
	151	20年国債		1.2000	65,000	74,505	2034/12/20
	18	30年国債		2.3000	20,000	26,821	2035/03/20
	152	20年国債		1.2000	61,000	69,855	2035/03/20
	19	30年国債		2.3000	15,000	20,129	2035/06/20
	153	20年国債		1.3000	65,000	75,622	2035/06/20
	20	30年国債		2.5000	16,000	22,087	2035/09/20
	154	20年国債		1.2000	67,000	76,706	2035/09/20

		当 期			末	
区 分		銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千 円	千 円	
	21	30年国債	2.3000	16,000	21,533	2035/12/20
	155	20年国債	1.0000	63,000	69,814	2035/12/20
	22	30年国債	2.5000	17,000	23,542	2036/03/20
	156	20年国債	0.4000	63,000	62,719	2036/03/20
	23	30年国債	2.5000	16,000	22,172	2036/06/20
	157	20年国債	0.2000	77,000	73,607	2036/06/20
	24	30年国債	2.5000	15,000	20,836	2036/09/20
	158	20年国債	0.5000	38,000	38,380	2036/09/20
	25	30年国債	2.3000	17,000	22,995	2036/12/20
	26	30年国債	2.4000	32,000	43,972	2037/03/20
	27	30年国債	2.5000	26,000	36,414	2037/09/20
	28	30年国債	2.5000	34,000	47,823	2038/03/20
	29	30年国債	2.4000	38,000	52,920	2038/09/20
	30	30年国債	2.3000	40,000	55,162	2039/03/20
	31	30年国債	2.2000	38,000	51,858	2039/09/20
	32	30年国債	2.3000	42,000	58,506	2040/03/20
	33	30年国債	2.0000	55,000	73,247	2040/09/20
	34	30年国債	2.2000	45,000	62,247	2041/03/20
	35	30年国債	2.0000	53,000	71,168	2041/09/20
	36	30年国債	2.0000	59,000	79,588	2042/03/20
	37	30年国債	1.9000	57,000	75,755	2042/09/20
	38	30年国債	1.8000	35,000	45,840	2043/03/20
	39	30年国債	1.9000	37,000	49,429	2043/06/20
	40	30年国債	1.8000	29,000	38,089	2043/09/20
	41	30年国債	1.7000	29,000	37,425	2043/12/20
	42	30年国債	1.7000	33,000	42,664	2044/03/20
	43	30年国債	1.7000	37,000	47,924	2044/06/20
	44	30年国債	1.7000	32,000	41,524	2044/09/20
	45	30年国債	1.5000	33,000	41,168	2044/12/20
	46	30年国債	1.5000	43,000	53,658	2045/03/20
	47	30年国債	1.6000	40,000	51,055	2045/06/20
	48	30年国債	1.4000	45,000	55,126	2045/09/20
	49	30年国債	1.4000	39,000	47,842	2045/12/20
	50	30年国債	0.8000	44,000	46,893	2046/03/20
	51	30年国債	0.3000	40,000	37,174	2046/06/20
	52	30年国債	0.5000	28,000	27,500	2046/09/20
	1	40年国債	2.4000	24,000	36,487	2048/03/20
	2	40年国債	2.2000	23,000	33,919	2049/03/20
	3	40年国債	2.2000	19,000	28,259	2050/03/20
	4	40年国債	2.2000	30,000	44,930	2051/03/20
	5	40年国債	2.0000	35,000	50,523	2052/03/20
	6	40年国債	1.9000	28,000	39,737	2053/03/20
	7	40年国債	1.7000	31,000	42,097	2054/03/20
	8	40年国債	1.4000	23,000	29,000	2055/03/20
	9	40年国債	0.4000	22,000	20,183	2056/03/20
種別	銘柄数	238銘柄				
小計	金 額			10,012,000	11,327,843	
地方債証券	24-6	京都市5年	0.1370	100,000	100,218	2018/03/28
	20-1	千葉市公債	1.5500	100,000	102,206	2018/04/25
	660	東京都公債	1.5800	100,000	102,499	2018/06/20
	20-6	北海道公債	1.7200	100,000	103,053	2018/08/29
	21-2	埼玉県公債	1.5700	100,000	104,004	2019/05/27
	76	共同発行地方	1.4000	100,000	103,808	2019/07/25

当 期 末					
区 分	銘 柄	年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	21-6 大阪市公債	1.5700	100,000	104,769	2019/11/25
	21-35 兵庫県公債	1.4600	100,000	104,644	2020/01/22
	116 共同発行地方	0.8000	100,000	104,582	2022/11/25
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	104,149	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	104,453	2023/01/31
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	99,550	2026/03/19
種別小計	銘柄数 12銘柄 金 額		1,200,000	1,237,940	
特殊債券 (除く金融債)	3 政保地方公共6年	0.4000	100,000	100,491	2018/01/30
	30 国際協力銀行	1.8700	100,000	102,396	2018/03/20
	56 政保道路機構	1.4000	100,000	101,956	2018/04/20
	2 政保地方公営機	1.6000	100,000	103,195	2018/11/16
	5 日本政策投資ＣＯ	1.7450	100,000	103,933	2019/03/20
	98 政保道路機構	1.3000	100,000	104,211	2020/01/31
	122 政保道路機構	0.9000	100,000	103,649	2020/11/30
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	103,857	2023/05/31
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	103,259	2024/10/28
種別小計	銘柄数 9銘柄 金 額		900,000	926,951	
普通社債券	15 ＮＴＴドコモ	1.9600	100,000	102,920	2018/06/20
	35 みずほＢＫ	0.2850	100,000	100,540	2019/01/25
	25 東日本高速道	0.2990	100,000	100,567	2019/03/20
	27 東日本高速道	0.2480	100,000	100,533	2019/06/20
	1 明治安田2014基	0.5100	100,000	100,653	2019/08/07
	164 オリックス	1.1460	100,000	102,682	2019/08/07
	62 トヨタファイナンス	0.2030	100,000	100,316	2019/12/20
	70 東日本旅客鉄道	1.1930	100,000	104,025	2020/09/29
	33 中日本高速道	1.0840	100,000	104,942	2021/09/17
種別小計	銘柄数 9銘柄 金 額		900,000	917,180	
合計	銘柄数 268銘柄 金 額		13,012,000	14,409,916	

(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	14,409,916	96.5
コール・ローン等、その他	525,756	3.5
投資信託財産総額	14,935,672	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	14,935,672,709円
コール・ローン等	276,660,168
公社債(評価額)	14,409,916,140
未収入金	203,477,000
未収利息	45,136,136
前払費用	483,265
(B) 負債	72,712,560
未払金	72,712,560
(C) 純資産総額(A－B)	14,862,960,149
元本	11,657,959,812
次期繰越損益金	3,205,000,337
(D) 受益権総口数	11,657,959,812口
1万口当り基準価額(C／D)	12,749円

* 期首における元本額は11,877,469,267円、当期中における追加設定元本額は1,948,518,971円、同解約元本額は2,168,028,426円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 34,845円、iFree 日本債券インデックス38,680,905円、iFree 8資産バランス48,315,209円、ダイワ・ライフ・バランス30 4,301,131,882円、ダイワ・ライフ・バランス50 2,079,325,322円、ダイワ・ライフ・バランス70 645,819,420円、DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／安定コース) 503,783,917円、DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／6分散コース) 410,849,190円、DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／成長コース) 119,616,392円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 59,505,016円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 37,620,868円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 2,109,162円、ダイワ世界バランスファンド40VA2,457,090,076円、ダイワ世界バランスファンド60VA234,409,930円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA266,358,395円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA453,309,283円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,749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	161,784,953円
受取利息	161,811,719
支払利息	△ 26,766
(B) 有価証券売買損益	428,834,950
売買益	500,992,880
売買損	△ 72,157,930
(C) その他費用	△ 237
(D) 当期損益金(A + B + C)	590,619,666
(E) 前期繰越損益金	2,655,621,973
(F) 解約差損益金	△ 576,583,438
(G) 追加信託差損益金	535,342,136
(H) 合計(D + E + F + G)	3,205,000,337
次期繰越損益金(H)	3,205,000,337

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

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

ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第10期（決算日 2016年12月19日）

（計算期間 2015年12月19日～2016年12月19日）

ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの第10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NOMUR A－B P I 総合短期指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主 要 投 資 対 象	わが国の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。）
運 用 方 法	主としてわが国の公社債等に投資し、ベンチマーク（NOMUR A－B P I 総合短期指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

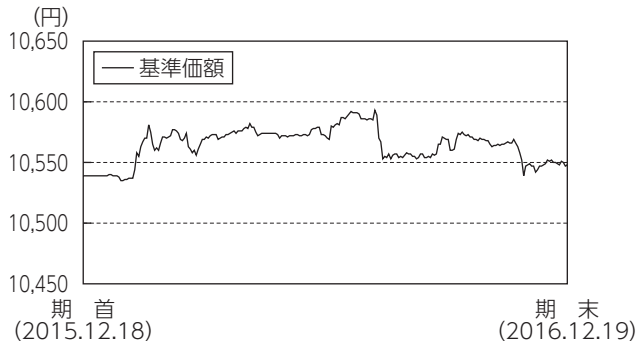
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総合短期指数 (ベンチマーク)		公 社 債 組入比率	債券先物 比 率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首)2015年12月18日	10,539	—	10,580	—	97.9	—
12月末	10,539	0.0	10,579	△0.0	98.1	—
2016年1月末	10,544	0.0	10,589	0.1	97.7	—
2月末	10,577	0.4	10,615	0.3	98.8	—
3月末	10,569	0.3	10,607	0.2	97.3	—
4月末	10,572	0.3	10,611	0.3	98.2	—
5月末	10,573	0.3	10,610	0.3	88.5	—
6月末	10,581	0.4	10,618	0.4	98.2	—
7月末	10,570	0.3	10,610	0.3	98.7	—
8月末	10,557	0.2	10,598	0.2	99.0	—
9月末	10,575	0.3	10,614	0.3	99.2	—
10月末	10,565	0.2	10,604	0.2	98.9	—
11月末	10,547	0.1	10,591	0.1	98.9	—
(期末)2016年12月19日	10,548	0.1	10,590	0.1	98.7	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) NOMURA-BPI総合短期指数は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。NOMURA-BPIは、野村證券株式会社が算出する、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数で、そのうち残存期間1～3年の部分の投資収益を表したものが総合短期指数です。

NOMURA-BPIは、野村證券株式会社が公表している指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負うものではありません。

(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。

(注4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,539円 期末：10,548円 騰落率：0.1%

【基準価額の主な変動要因】

債券からの利息収入に加えて、金利水準の低下により債券価格が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○国内短期債券市況

国内短期債券市況は、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て、金利（2年金利）は2月にかけて大きく低下し、その後も、追加金融緩和への期待などから低下基調で推

移しました。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、金利（2年金利）は8月上旬にかけて急上昇した後、横ばい圏で推移しました。その後はいったんレンジを切下げましたが、11月中旬以降は円安・株高が進む中で日銀の追加緩和観測が後退したことなどから金利（2年金利）は上昇しました。

◆前期における「今後の運用方針」

今後もベンチマーク（NOMURA-BPI総合短期指数）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98%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レション、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

当ファンドとベンチマークとの騰落率の差は△0.0%とごくわずかなとなり、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

《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」の項目の概要を参照ください。

■売買および取引の状況

公 社 債
(2015年12月19日から2016年12月19日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国債証券	797,063	578,572 (－)
	地方債証券	－	103,641 (－)
	特殊債券	－	170,672 (－)

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

■主要な売買銘柄

公 社 債
(2015年12月19日から2016年12月19日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
117 5年国債 0.2% 2019/3/20	141,986	106 5年国債 0.2% 2017/9/20	120,712
122 5年国債 0.1% 2019/12/20	95,731	20-2 北海道公債 1.88% 2018/5/30	103,641
364 2年国債 0.1% 2018/5/15	93,628	い745 利付農林債 0.35% 2017/6/27	100,379
121 5年国債 0.1% 2019/9/20	92,828	108 5年国債 0.1% 2017/12/20	100,373
370 2年国債 0.1% 2018/11/15	80,431	357 2年国債 0.1% 2017/10/15	90,331
119 5年国債 0.1% 2019/6/20	65,708	288 10年国債 1.7% 2017/9/20	82,263
365 2年国債 0.1% 2018/6/15	65,546	289 10年国債 1.5% 2017/12/20	77,390
353 2年国債 0.1% 2017/6/15	60,218	269 信金中金 0.4% 2017/4/27	70,293
116 5年国債 0.2% 2018/12/20	45,316	353 2年国債 0.1% 2017/6/15	60,231
118 5年国債 0.2% 2019/6/20	29,454	355 2年国債 0.1% 2017/8/15	20,061

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

■組入資産明細表

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

作 成 期	当			期 末			
区 分	額面金額	評 価 額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円 993,000	千円 999,924	% 98.7	% －	% －	% 56.1	% 42.6

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

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

当		期		末	
区 分	銘 柄	年利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	111 5年国債	% 0.4000	千円 135,000	千円 136,102	2018/03/20
	364 2年国債	0.1000	93,000	93,436	2018/05/15
	365 2年国債	0.1000	65,000	65,304	2018/06/15
	366 2年国債	0.1000	1,000	1,004	2018/07/15
	368 2年国債	0.1000	10,000	10,052	2018/09/15
	115 5年国債	0.2000	45,000	45,315	2018/09/20
	370 2年国債	0.1000	80,000	80,449	2018/11/15
	116 5年国債	0.2000	146,000	147,111	2018/12/20
	117 5年国債	0.2000	140,000	141,166	2019/03/20
	118 5年国債	0.2000	29,000	29,265	2019/06/20
	119 5年国債	0.1000	65,000	65,431	2019/06/20
	121 5年国債	0.1000	89,000	89,613	2019/09/20
	122 5年国債	0.1000	95,000	95,671	2019/12/20
合計	銘柄数 金 額	13銘柄	993,000	999,924	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年12月19日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
公社債	千円 999,924	% 98.7
コール・ローン等、その他	12,677	1.3
投資信託財産総額	1,012,601	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12月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,012,601,606円
コール・ローン等	12,157,946
公社債(評価額)	999,924,210
未収利息	455,878
前払費用	63,572
(B) 負債	－
(C) 純資産総額(A－B)	1,012,601,606
元本	960,030,825
次期繰越損益金	52,570,781
(D) 受益権総口数	960,030,825口
1万口当り基準価額(C／D)	10,548円

* 期首における元本額は1,025,931,977円、当期中における追加設定元本額は31,198,924円、同解約元本額は97,100,076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、ダイワ世界分散バランスファンド1 5 V A 1,394,173円、ダイワ世界分散バランスファンド2 0 V A 1,371,875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) 1,423,535円、ダイワ世界分散バランスファンド2 5 V A 116,123,244円、ダイワ世界分散バランスファンド3 0 V A 658,121,399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) 181,596,599円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,548円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月19日 至2016年12月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,251,696円
受取利息	4,250,726
その他収益金	4,959
支払利息	△ 3,989
(B) 有価証券売買損益	△ 3,267,210
売買益	767,010
売買損	△ 4,034,220
(C) その他費用	△ 37
(D) 当期損益金(A + B + C)	984,449
(E) 前期繰越損益金	55,329,180
(F) 解約差損益金	△ 5,477,924
(G) 追加信託差損益金	1,735,076
(H) 合計(D + E + F + G)	52,570,781
次期繰越損益金(H)	52,570,781

(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。

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第17期（決算日 2016年11月30日）

（計算期間 2015年12月1日～2016年11月30日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針	投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主 要 投 資 対 象	外国の公社債
運 用 方 法	①主として外国の公社債に投資し、投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
株 式 組 入 制 限	純資産総額の30%以下

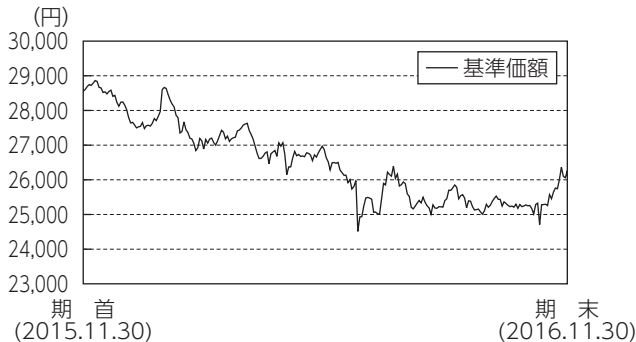
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公 社 債 組 入 比 率	債券先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首)2015年11月30日	28,558	—	28,825	—	98.3	—
12月末	28,152	△ 1.4	28,344	△ 1.7	97.9	—
2016年 1 月末	28,599	0.1	28,342	△ 1.7	98.4	—
2 月末	27,127	△ 5.0	27,450	△ 4.8	98.6	—
3 月末	27,610	△ 3.3	27,848	△ 3.4	97.2	—
4 月末	26,734	△ 6.4	27,341	△ 5.1	97.9	—
5 月末	26,968	△ 5.6	27,251	△ 5.5	97.5	—
6 月末	25,473	△ 10.8	25,637	△ 11.1	97.8	—
7 月末	25,888	△ 9.3	26,231	△ 9.0	97.8	—
8 月末	25,699	△ 10.0	25,857	△ 10.3	97.6	—
9 月末	25,208	△ 11.7	25,609	△ 11.2	98.0	—
10 月末	25,250	△ 11.6	25,581	△ 11.3	97.9	—
(期末)2016年11月30日	26,265	△ 8.0	26,597	△ 7.7	98.4	—

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：28,558円 期末：26,265円 騰落率：△8.0%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外債券市況

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

○為替相場

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー (両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの) は0.12%程度でした。ただし、これはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。

《今後の運用方針》

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

外国債券インデックスマザーファンド

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	7 (7)
合 計	7

(注 1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって
受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。費用の項
目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の項目の概
要をご参照ください。
(注 2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況
公 社 債

(2015年12月 1 日から2016年11月30日まで)

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

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

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

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国 (外貨建) 公社債 (通貨別)

作 成 期		当		期		未	
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上 2 年 未 満
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	% —	% 17.6	% 17.7
カナダ	千カナダ・ドル 34,684	千カナダ・ドル 38,441	3,216,825	2.1	—	1.0	0.6
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 34,514	千オーストラリア・ドル 37,263	3,135,370	2.0	—	1.3	0.6
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,037	千シンガポール・ドル 7,286	575,419	0.4	—	0.2	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 62,812	千イギリス・ポンド 78,823	11,071,541	7.1	—	5.1	1.6
スイス	千スイス・フラン 2,792	千スイス・フラン 3,304	367,180	0.2	—	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 51,791	千デンマーク・クローネ 65,733	1,057,649	0.7	—	0.4	0.2
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 28,227	千ノルウェー・クローネ 30,237	398,524	0.3	—	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 47,400	千スウェーデン・クローネ 55,521	680,141	0.4	—	0.3	0.2
メキシコ	千メキシコ・ペソ 219,416	千メキシコ・ペソ 225,977	1,231,577	0.8	—	0.4	0.3
マレーシア	千マレーシア・リンギット 27,216	千マレーシア・リンギット 26,495	667,167	0.4	—	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 104,423	千南アフリカ・ランド 94,587	766,157	0.5	—	0.4	0.1
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 31,114	千ポーランド・ズロチ 31,602	852,954	0.6	—	0.2	0.3
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 8,336	千ユーロ 9,775	1,170,103	0.8	—	0.4	0.3
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 25,028	千ユーロ 30,098	3,602,804	2.3	—	1.4	0.5
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 25,843	千ユーロ 32,303	3,866,730	2.5	—	1.8	0.5
ユーロ (フランス)	千ユーロ 104,489	千ユーロ 125,253	14,992,864	9.7	—	6.0	2.8
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 78,396	千ユーロ 94,031	11,255,580	7.3	—	4.2	2.2
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 59,673	千ユーロ 69,975	8,376,016	5.4	—	3.3	1.5
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 105,758	千ユーロ 121,214	14,509,366	9.4	—	5.6	2.9
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 6,718	千ユーロ 7,626	912,887	0.6	—	0.4	0.2

外国債券インデックスマザーファンド

作成期 区分	額面金額	当期				期末			
		評価額		組入比率	うちBＢ格 以下組入比率	残存期間別		組入比率	
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上		
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 15,749	千ユーロ 19,264	千円 2,305,937	% 1.5	% －	% 0.9	% 0.4	% 0.1	% 0.1
ユーロ (小計)	429,990	509,542	60,992,290	39.4	－	24.1	11.3	4.0	
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)

当		期			末														
区	分	銘	柄	種	類	年	利	率	額	面	金	額	評		償	還	年	月	日
													外	貨					
アメリカ		United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	%	千	アメリカ・ドル	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	2019/05/31								
		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	2017/11/30									
	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									

区 分	当 期	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 償 還 金 額		償 還 年 月 日
						評 価 額	外 貨 建 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

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	当 期	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 償 還 金 額		償 還 年 月 日
						評 価 額	評 価 額	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	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

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 償 還 金 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	2022/12/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	2,492	2,505	281,638	2022/12/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,146	2,145	241,185	2019/01/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	3,126	3,085	346,891	2021/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	5,366	5,062	569,071	2026/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,329	2,324	261,281	2018/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,065	2,047	230,160	2019/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,561	2,518	283,093	2023/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	3,428	3,110	349,728	2046/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,100	2,092	235,203	2019/03/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	3,309	3,230	363,133	2021/02/28
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,262	2,188	246,029	2023/02/28
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	3,002	2,942	330,785	2021/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	700	699	78,604	2018/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,123	2,051	230,667	2023/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	1,125	1,116	125,558	2019/04/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	5,529	5,207	585,388	2026/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,450	2,412	271,168	2021/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	4,300	4,286	481,834	2018/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,070	2,014	226,454	2023/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	3,423	3,106	349,187	2046/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	2,507	2,486	279,511	2019/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	4,000	3,992	448,888	2018/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,700	2,657	298,765	2021/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,500	2,430	273,208	2023/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	2,100	2,081	233,969	2019/06/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	1,000	993	111,738	2018/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	2,500	2,429	273,121	2021/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	3,000	2,868	322,504	2023/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,500	2,466	277,303	2019/07/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	5,600	5,203	584,941	2026/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	3,480	2,987	335,805	2046/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,500	2,463	276,997	2019/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,200	2,188	245,981	2018/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	3,700	3,589	403,571	2021/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	1,770	1,761	198,026	2018/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	3,700	3,591	403,733	2021/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	2,780	2,634	296,166	2023/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,400	2,291	257,558	2023/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	2,600	2,569	288,807	2019/09/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	3,000	2,982	335,243	2018/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,505	2,389	268,652	2023/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	3,042	2,946	331,294	2021/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.0000	2,147	2,126	239,072	2019/10/15
		United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	2,326	2,310	259,781	2018/10/31
通貨小計	銘 柄 数 額	237銘柄			590,540	599,940	67,445,294	
カナダ		Canada Government International Bond	国 債 証 券	2.7500	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	8.0000	325	389	32,602	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	386	623	52,150	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	983	1,419	118,747	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.0000	1,127	1,722	144,165	2037/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	1,192	1,768	147,961	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	969	1,020	85,417	2019/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,524	1,639	137,169	2021/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	1,413	1,913	160,140	2023/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,476	1,612	134,893	2020/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	956	1,053	88,138	2021/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	1,351	1,471	123,152	2022/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,491	1,929	161,493	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,265	1,276	106,794	2023/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,021	1,074	106,657	2018/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	873	1,231	86,307	2018/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	853	1,524	127,547	2024/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,627	873	73,071	2019/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	847	1,671	139,894	2019/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,156	972	81,409	2048/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	829	1,232	103,104	2025/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	872	847	70,905	2020/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,772	1,784	149,363	2018/02/01

外国債券インデックスマザーファンド

当		期			未		
区	銘	柄	種	年	額	評	額
分				利	面	外	賃
				率	金	貨	還
					額	建	年
						金	月
						額	日
				%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円
				0.7500	931	927	77,617
				1.5000	1,029	1,027	85,973
				0.2500	1,128	1,124	94,083
				0.7500	1,237	1,228	102,812
				0.2500	1,284	1,276	106,821
				0.7500	980	970	81,231
				0.5000	1,344	1,340	112,143
				1.0000	390	366	30,662
				0.5000	800	797	66,721
				0.5000	340	330	27,671
通貨小計	銘	柄	数				
	金	額	額		34,684	38,441	3,216,825
オーストラリア					千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	
				5.2500	2,455	2,642	222,320
				5.7500	2,420	2,795	235,185
				4.5000	2,209	2,391	201,240
				5.7500	2,032	2,406	202,494
				5.5000	2,063	2,151	181,056
				5.5000	2,068	2,450	206,174
				4.7500	2,589	3,066	258,016
				2.7500	2,173	2,209	185,929
				3.2500	1,314	1,362	114,641
				3.2500	2,398	2,516	211,714
				4.5000	958	1,127	94,871
				3.2500	1,197	1,230	103,500
				4.2500	2,848	3,224	271,333
				2.7500	1,511	1,547	130,191
				3.7500	863	914	76,950
				2.7500	557	516	43,458
				1.7500	1,495	1,478	124,420
				3.2500	412	400	33,659
				2.7500	1,592	1,589	133,719
				2.2500	678	640	53,877
				3.0000	682	601	50,611
通貨小計	銘	柄	数				
	金	額	額		34,514	37,263	3,135,370
シンガポール					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	
				4.0000	491	515	40,729
				3.2500	696	740	58,497
				3.5000	442	485	38,360
				3.1250	438	466	36,864
				2.5000	599	617	48,736
				3.0000	503	531	41,946
				2.8750	359	366	28,948
				2.2500	495	507	40,106
				2.7500	400	402	31,745
				0.5000	504	500	39,509
				2.7500	421	438	34,619
				3.3750	238	257	20,354
				2.8750	125	128	10,172
				1.6250	270	272	21,503

当		期				未		償還年月日	
区	銘	柄	種	類	年 利 率	額 面 金 額	評 価		
							外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					%	千円	千円	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	39銘柄							
	金 額					62,812	78,823	11,071,541	
スイス	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	6銘柄							
	金 額					2,792	3,304	367,180	
デンマーク	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	8銘柄							
	金 額					51,791	65,733	1,057,649	
ノルウェー	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	6銘柄							
	金 額					28,227	30,237	398,524	
スウェーデン	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	7銘柄							
	金 額					47,400	55,521	680,141	

外国債券インデックスマザーファンド

当		期				末																																	
区		銘		柄		種		類		年		利		率		額		面		金		額		評		価		額		償		還		年		月		日	
分		銘		柄		種		類		年		利		率		額		面		金		額		評		価		額		償		還		年		月		日	
メキシコ		Mexican Bonos		国	債	証	券	5.0000	%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	14,937	81,411	2019/12/11																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	5.7500					7,590	37,055	2026/03/05																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	8.0000					8,610	46,926	2023/12/07																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	10.0000					21,119	134,232	2024/12/05																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	7.5000					8,568	46,912	2027/06/03																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	7.7500					13,756	76,263	2017/12/14																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	10.0000					6,874	46,543	2036/11/20																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	8.5000					8,844	52,094	2029/05/31																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	8.5000					22,092	124,793	2018/12/13																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	8.5000					9,694	57,565	2038/11/18																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	8.0000					12,728	72,112	2020/06/11																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	6.5000					21,194	115,508	2021/06/10																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	7.7500					13,015	72,109	2031/05/29																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	6.5000					11,399	60,436	2022/06/09																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	7.7500					14,654	80,666	2042/11/13																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	4.7500					16,633	88,549	2018/06/14																								
		Mexican Bonos		国	債	証	券	7.7500					6,944	38,396	2034/11/23																								
通貨小計		銘金	柄数	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	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	16,930	2019/07/30																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.5020					517	13,029	2027/05/31																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	5.2480					770	19,406	2028/09/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	4.3780					1,603	40,573	2019/11/29																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	4.4980					1,178	28,724	2030/04/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	4.1600					1,916	48,150	2021/07/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	4.3920					1,514	36,860	2026/04/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	4.2320					420	9,953	2031/06/30																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.5800					1,595	39,949	2018/09/28																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.4180					875	20,888	2022/08/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.8920					731	17,073	2027/03/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	4.1270					618	14,106	2032/04/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.3140					599	15,052	2017/10/31																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.4920					1,044	25,621	2020/03/31																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.2600					533	13,307	2018/03/01																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.4800					1,001	23,638	2023/03/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.8440					477	10,700	2033/04/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.7330					586	13,354	2028/06/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.8890					645	16,258	2020/07/31																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	4.9350					600	14,790	2043/09/30																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	4.1810					1,057	25,898	2024/07/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	4.0480					857	21,422	2021/09/30																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.6540					648	16,115	2019/10/31																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.9550					737	17,691	2025/09/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.6590					700	17,315	2020/10/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.7950					1,115	28,079	2022/09/30																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	4.2540					620	14,429	2035/05/31																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.7590					768	19,278	2019/03/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.8000					702	17,174	2023/08/17																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	4.7360					450	10,948	2046/03/15																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.9000					50	1,202	2026/11/30																								
		MALAYSIAN GOVERNMENT		国	債	証	券	3.6200					352	8,676	2021/11/30																								
通貨小計		銘金	柄数	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	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	45,480	2020/01/15																								
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国	債	証	券	10.5000					15,434	137,329	2026/12/21																								
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国	債	証	券	6.2500					7,612	43,731	2036/03/31																								
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国	債	証	券	6.7500					6,122	46,624	2021/03/31																								
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国	債	証	券	6.5000					8,904	50,752	2041/02/28																								
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国	債	証	券	7.0000					8,999	59,365	2031/02/28																								
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国	債	証	券	7.7500					4,639	35,877	2023/02/28																								
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国	債	証	券	8.7500					10,852	79,460	2048/02/28																								
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国	債	証	券	8.5000					7,321	53,055	2037/01/31																								
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国	債	証	券	8.0000					7,862	57,091	2030/01/31																								
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国	債	証	券																																

当			期			未																
区		分	銘	柄	種	年	利	率	額	面	金	額	評	建	価	額	償	還	年	月	日	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国	債	証	券	8.8750 9.0000	% 	千南アフリカ・ランド 千南アフリカ・ランド	3,166 1,579	2,957 1,472	千円 千円	23,954 11,930	2035/02/28 2040/01/31						
通貨小計		銘	柄	数							104,423	94,587			766,157							
		金	額																			
ポーランド			Poland Government Bond		国	債	証	券	5.7500		千ポーランド・ズロチ	2,309			70,841	2022/09/23						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	5.5000			1,912			56,275	2019/10/25						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	1.5000			2,078			54,428	2020/04/25						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	2.5000			3,377			82,956	2026/07/25						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	2.0000			2,127			55,512	2021/04/25						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	—			1,668			43,439	2018/10/25						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	1.7500			3,051			78,429	2021/07/25						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	5.7500			627			20,198	2029/04/25						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	5.2500			2,256			66,885	2020/10/25						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	5.7500			884			26,941	2021/10/25						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	4.0000			2,575			72,368	2023/10/25						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	3.7500			1,720			47,703	2018/04/25						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	2.5000			2,099			57,341	2018/07/25						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	3.2500			1,840			51,111	2019/07/25						
			Poland Government Bond		国	債	証	券	3.2500			2,591			68,520	2025/07/25						
通貨小計		銘	柄	数							31,114	31,602			852,954							
		金	額																			
ユーロ (アイルランド)			IRISH TREASURY		国	債	証	券	4.5000		千ユーロ	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							
		金	額																			
ユーロ (オランダ)			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	7.5000		千ユーロ	548		810	97,025	2023/01/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	5.5000			1,239		1,918	229,702	2028/01/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.0000			1,355		2,168	259,569	2037/01/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	3.7500			791		986	118,036	2023/01/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.0000			1,544		1,663	199,097	2018/07/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	4.0000			1,347		1,514	181,301	2019/07/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	3.5000			1,146		1,318	157,806	2020/07/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	3.7500			1,349		2,224	266,240	2042/01/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	3.2500			1,463		1,716	205,481	2021/07/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.2500			1,438		1,646	197,104	2022/07/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.5000			1,168		1,487	178,061	2033/01/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.2500			1,477		1,510	180,838	2018/01/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.7500			1,385		1,558	186,595	2023/07/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	1.2500			924		962	115,270	2019/01/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.7500			1,004		1,468	175,726	2047/01/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	2.0000			1,514		1,736	207,914	2024/07/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.2500			1,374		1,412	169,115	2020/01/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	—			1,323		1,336	159,954	2018/04/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.2500			1,291		1,291	154,596	2025/07/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	0.5000			948		958	114,682	2026/07/15						
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	—			400		406	48,681	2022/01/15						
国小計		銘	柄	数							25,028	30,098			3,602,804							
		金	額																			
ユーロ (ベルギー)			Belgium Government Bond		国	債	証	券	0.8000		千ユーロ	1,399		1,444	172,899	2025/06/22						
			Belgium Government Bond		国	債	証	券	1.0000			924		927	111,056	2031/06/22						
			Belgium Government Bond		国	債	証	券	1.9000			558		630	75,434	2038/06/22						
			Belgium Government Bond		国	債	証	券	1.0000			1,283		1,331	159,360	2026/06/22						
			Belgium Government Bond		国	債	証	券	1.6000			544		557	66,725	2047/06/22						
			Belgium Government Bond		国	債	証	券	2.1500			290		327	39,204	2066/06/22						
			Belgium Government Bond		国	債	証	券	0.2000			150		151	18,138	2023/10/22						

外国債券インデックスマザーファンド

当		期										未																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																					
区		銘		柄		種		類		年		利		率		額		面		金		額		評		価		額		償		還		年		月		日																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																											
																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																</	

当		期				末			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	ユー	ロ		千	ユー	ロ		千	ユー	ロ		千	ユー	ロ		千	ユー	ロ
		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	額	50銘柄					78,396		94,031		11,255,580												
												千ユーロ		千ユーロ														
ユーロ (スペイン)		SPANISH GOVERNMENT BOND		国	債	証	券	6.0000		1,832			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		

外国債券インデックスマザーファンド

当		期			末														
区	分	銘	柄	種	類	年	利	率	額	面	金	額	評		償	還	年	月	日
													外	貨					

当		期										未																					
区		銘		柄		種		年		利		率		額		面		金		額		評		価		還		年		月		日	
																						外		貨		建		金		額		額	
																						千		ユーロ		千		円					
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		4.7500																								2021/09/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		5.0000																								2022/03/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		5.5000																								2022/09/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		5.5000																								2022/11/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		3.5000																								2017/11/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		4.7500																								2028/09/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		4.5000																								2023/05/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		3.5000																								2018/06/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		4.7500																								2044/09/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		4.5000																								2024/03/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		3.5000																								2018/12/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		3.7500																								2021/05/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		2.5000																								2019/05/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		3.7500																								2024/09/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		3.5000																								2030/03/01
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		2.1500																								2021/12/15
		Italy	Buoni Poliennali Del Tesoro	国	債	証	券		1.5000																								2019/08/01
国小計		銘金	柄数	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														2020/09/15
		Finland Government Bond	国	債	証	券		0.7500							414				411														2031/04/15
		Finland Government Bond	国	債	証	券		0.8750							279				292														2025/09/15
		Finland Government Bond	国	債	証	券		0.5000							411				414														2026/04/15
		Finland Government Bond	国	債	証	券		-							200				199														2023/09/15
		Finland Government Bond	国	債	証	券		4.3750							416				470														2019/07/04
		Finland Government Bond	国	債	証	券		4.0000							667				882														2025/07/04
		Finland Government Bond	国	債	証	券		3.3750							632				716														2020/04/15
		Finland Government Bond	国	債	証	券		3.5000							459				537														2021/04/15
		Finland Government Bond	国	債	証	券		2.7500							389				484														2028/07/04
		Finland Government Bond	国	債	証	券		1.6250							612				677														2022/09/15
		Finland Government Bond	国	債	証	券		1.5000							446				491														2023/04/15
		Finland Government Bond	国	債	証	券		2.6250							407				558														2042/07/04
		Finland Government Bond	国	債	証	券		1.1250							425				438														2018/09/15
		Finland Government Bond	国	債	証	券		2.0000							529				603														2024/04/15
国小計		銘金	柄数	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														2019/10/18
		Austria Government Bond	国	債	証	券		1.2000							873				939														2025/10/20
		Austria Government Bond	国	債	証	券		0.7500							576				588														2026/10/20
		Austria Government Bond	国	債	証	券		1.5000							234				245														2047/02/20
		Austria Government Bond	国	債	証	券		6.2500							985				1,575														2027/07/15
		Austria Government Bond	国	債	証	券		4.6500							1,066				1,131														2018/01/15
		Austria Government Bond	国	債	証	券		3.9000							1,248				1,446														2020/07/15
		Austria Government Bond	国	債	証	券		3.5000							1,337				1,583														2021/09/15
		Austria Government Bond	国	債	証	券		4.1500							1,073				1,692														2037/03/15
		Austria Government Bond	国	債	証	券		4.3500							989				1,102														2019/03/15
		Austria Government Bond	国	債	証	券		4.8500							675				953														2026/03/15
		Austria Government Bond	国	債	証	券		3.6500							797				963														2022/04/20
		Austria Government Bond	国	債	証	券		3.4000							872				1,056														2022/11/22
		Austria Government Bond	国	債	証	券		3.8000							318				574														2062/01/26
		Austria Government Bond	国	債	証	券		1.9500							738				787														2019/06/18
		Austria Government Bond	国	債	証	券		3.1500							623				907														2044/06/20
		Austria Government Bond	国	債	証	券		1.7500							959				1,076														2023/10/20
		Austria Government Bond	国	債	証	券		2.4000							501				620														2034/05/23
		Austria Government Bond	国	債	証	券		1.1500							426				440														2018/10/19
		Austria Government Bond	国	債	証	券		1.6500							932				1,039														2024/10/21
国小計		銘金	柄数	20銘柄										15,749				19,264				2,305,937											
通貨小計		銘金	柄数	287銘柄										429,990				509,542				60,992,290											
合計		銘金	柄数	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。

外国債券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 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	152,458,096	98.2
コール・ローン等、その他	2,858,154	1.8
投資信託財産総額	155,316,251	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1 アメリカ・ドル＝112.42円、1 カナダ・ドル＝83.68円、1 オーストラリア・ドル＝84.14円、1 シンガポール・ドル＝78.97円、1 イギリス・ポンド＝140.46円、1 スイス・フラン＝111.11円、1 デンマーク・クローネ＝16.09円、1 ノルウェー・クローネ＝13.18円、1 スウェーデン・クローネ＝12.25円、1 メキシコ・ペソ＝5.45円、1 マレーシア・リンギット＝25.18円、1 南アフリカ・ランド＝8.10円、1 ポーランド・ズロチ＝26.99円、1 ユーロ＝119.70円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（153,945,576千円）の投資信託財産総額（155,316,251千円）に対する比率は、99.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年11月30日現在

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

* 期首における元本額は57,305,049,313円、当期中における追加設定元本額は5,269,599,218円、同解約元本額は3,568,516,951円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスV A 1,426,188,983円、ダイワ国内重視バランスファンド3 0 V A（一般投資家私募）47,463,120円、ダイワ国内重視バランスファンド5 0 V A（一般投資家私募）340,370,920円、ダイワ国際分散バランスファンド3 0 V A（一般投資家私募）85,931,327円、ダイワ国際分散バランスファンド5 0 V A（一般投資家私募）1,134,382,139円、ダイワファンドラップ外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）45,058,356円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）79,097,081円、D－1's 外国債券インデックス850,783円、D Cダイワ・ターゲッティヤー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・ターゲッティヤー2020 12,384,412円、D Cダイワ・ターゲッティヤー2030 15,705,795円、D Cダイワ・ターゲッティヤー2040 932,613円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A 1,705,288,856円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 194,065,438円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 7,200,012,883円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 519,885,779円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 335,883,404円、ダイワ・バランスファンド2 5 V A（適格機関投資家専用）396,659,545円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券103,331,290円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド7,209,795円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,614,367,146円、ダイワライフスタイル2 5 35,139,131円、ダイワライフスタイル5 0 55,152,766円、ダイワライフスタイル7 5 14,282,989円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は26,265円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月1日 至2016年11月30日

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

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

ダイワ・マネー・マザーファンド

運用報告書 第12期（決算日 2016年12月9日）

（計算期間 2015年12月10日～2016年12月9日）

ダイワ・マネー・マザーファンドの第12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	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	本邦通貨表示の公社債
運 用 方 法	①わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。 ②邦貨建資産の組み入れにあたっては、取得時に第二位（A-2格相当）以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、コマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
株 式 組 入 制 限	純資産総額の30%以下

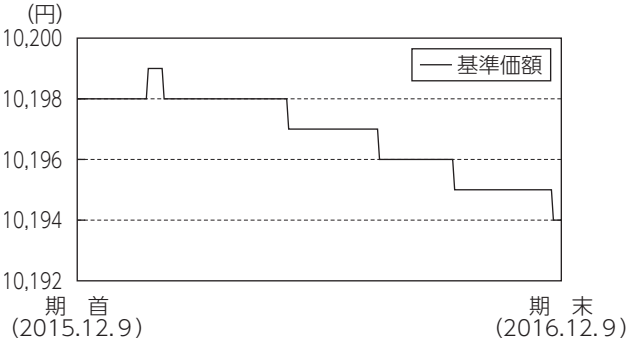
大和投資信託

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/>

■当期中の基準価額の推移



年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率	
	円	騰 落 率 %	組 入 比 率 %	
(期首)2015年12月9日	10,198	—	55.2	
12月末	10,198	0.0	52.1	
2016年1月末	10,198	0.0	94.1	
2月末	10,198	0.0	50.0	
3月末	10,198	0.0	—	
4月末	10,198	0.0	3.3	
5月末	10,197	△0.0	0.1	
6月末	10,197	△0.0	1.6	
7月末	10,196	△0.0	19.1	
8月末	10,196	△0.0	44.5	
9月末	10,195	△0.0	25.5	
10月末	10,195	△0.0	3.4	
11月末	10,195	△0.0	26.7	
(期末)2016年12月9日	10,194	△0.0	30.1	

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。
(注3) 当ファンドは、利息収入の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】
期首：10,198円 期末：10,194円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】
低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場
期首より、日銀は量的・質的金融緩和を継続し、2016年1月にはマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入を、9月には長短金利操作付き量的・質的金融緩和の導入を決定しました。このような日銀の金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利は低下しました。

◆前期における「今後の運用方針」

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行なっております。

◆ポートフォリオについて

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債、現先取引およびコール・ローン等による運用を行ないました。

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

■1万口当りの費用の明細

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

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。
(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 公 社 債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

国 内	国債証券	買 付 額	売 付 額
		千円	千円
		285,828,471	11,349,138 (297,450,000)

(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、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 単位未満は切捨て。

(2) その他有価証券

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

国 内	国内短期社債等	買 付 額	売 付 額
		千円	千円
		17,999,984	16,999,986

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

当 期			
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
613 国庫短期証券 2016/9/12	27,280,379	567 国庫短期証券 2016/2/8	4,999,980
591 国庫短期証券 2016/5/30	24,330,973	566 国庫短期証券 2016/2/1	2,999,991
611 国庫短期証券 2016/9/5	19,330,584	342 2年国債 0.1% 2016/7/15	2,095,779
601 国庫短期証券 2016/7/19	19,020,392	100 5年国債 0.3% 2016/9/20	1,253,387
629 国庫短期証券 2016/11/28	14,720,456		
596 国庫短期証券 2016/6/20	14,390,312		
632 国庫短期証券 2016/12/12	14,020,490		
588 国庫短期証券 2016/5/16	12,500,147		
609 国庫短期証券 2016/8/22	10,870,238		
610 国庫短期証券 2016/8/29	10,390,257		

(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）

区 分	当 期			期 末			
	額面金額	評 価 額	組入比率	うちB B 格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	20,580,000	20,580,364	30.1	—	—	—	30.1

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

区 分	銘 柄	当 期			期 末		
		年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日		
		%	千円	千円			
国債証券	632 国庫短期証券	—	14,020,000	14,020,113	2016/12/12		
	634 国庫短期証券	—	2,010,000	2,010,039	2016/12/19		
	635 国庫短期証券	—	4,550,000	4,550,211	2016/12/26		
合計	銘柄数 金 額	-----3銘柄	-----	20,580,000	20,580,364	-----	

(注) 単位未満は切捨て。

(3) 国内その他有価証券

	当 期			期 末		
	評 価 額	比	率	評 価 額	比	率
	千円	%		千円	%	
国内短期社債等	999,999		<1.5>			

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年12月9日現在

項 目	当 期			期 末		
	評 価 額	比	率	評 価 額	比	率
	千円	%		千円	%	
公社債	20,580,364		27.2			
その他有価証券	999,999		1.3			
コール・ローン等、その他	53,984,185		71.4			
投資信託財産総額	75,564,549		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12月9日現在

項 目	当 期	期 末
(A) 資産	75,564,549,239円	
コール・ローン等	53,983,440,401	
公社債(評価額)	20,580,364,994	
現先取引(その他有価証券)	999,999,178	
その他未収収益	744,666	
(B) 負債	7,294,738,200	
未払金	1,800,034,200	
未払解約金	5,494,704,000	
(C) 純資産総額(A－B)	68,269,811,039	
元本	66,967,614,984	
次期繰越損益金	1,302,196,055	
(D) 受益総口数	66,967,614,984口	
1万口当り基準価額(C／D)	10,194円	

* 期首における元本額は77,361,886,547円、当期中における追加設定元本額は229,319,669,570円、同解約元本額は239,713,941,133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 F E グローバル・バリュー（為替ヘッジあり）98,069円、ダイワ F E グローバル・バリュー（為替ヘッジなし）98,069円、ダイワ／ ＊ R I C I Ⅱ ＊ コモディ

ティ・ファンド8,952,508円、U S 債券N B戦略ファンド（為替ヘッジあり／年1回決算型）740,564円、U S 債券N B戦略ファンド（為替ヘッジなし／年1回決算型）1,623,350円、スマート・アロケーション・Dガード1,987,559円、N Bストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>米ドルコース981円、N Bストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>円コース981円、N Bストラテジック・インカム・ファンド<ラップ>世界通貨分散コース981円、堅実バランスファンド－ハジメの歩－129,891,397円、D Cダイワ・マネー・ポートフォリオ2,529,071,704円、ダイワファンドラップ コモディティセレクト317,088,630円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）ートリプルリターンズ－日本・コース（毎月分配型）132,757円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）ートリプルリターンズ－豪ドル・コース（毎月分配型）643,132円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）ートリプルリターンズ－ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）4,401,613円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）ートリプルリターンズ－米ドル・コース（毎月分配型）12,784円、ダイワノフィデリティ北米株式ファンド－パラダイムシフト－29,484,934円、（適格機関投資家専用）スマート・シックス・Dガード495,850,899円、ブルベア・マネー・ポートフォリオⅣ21,858,178,543円、ブル3倍日本株ポートフォリオⅣ34,413,293,504円、ベア2倍日本株ポートフォリオⅣ6,512,563,667円、ダイワ F E グローバル・バリュー株ファンド（ダイワ S M A 専用）4,090,590円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）ブラジル・リアル・コース（毎月分配型）98,290,744円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）日本・コース（毎月分配型）23,590,527円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）米ドル・コース（毎月分配型）2,163,360円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）豪ドル・コース（毎月分配型）13,761,552円、ダイワ／アムンディ食糧増産関連ファンド4,974,315円、ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ197,896,688円、ダイワ新興国ハイインカム・プラスⅡ－金積立型－501,660円、ダイワ新興国ハイインカム債券ファンド（償還案項付込）為替ヘッジあり1,004,378円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド（資産成長コース）49,082,149円、ダイワ新興国ソブリン債券ファンド（通貨αコース）196,290,094円、ダイワ・ダブルバランス・ファンド（Dガード付／部分為替ヘッジあり）27,494,856円、ダイワ・インフラビジネス・ファンド－インフラ革命－（為替ヘッジあり）988,283円、ダイワ・インフラビジネス・ファンド－インフラ革命－（為替ヘッジなし）4,926,018円、ダイワ米国 M L P ファンド（毎月分配型）米ドルコース13,732,222円、ダイワ米国 M L P ファンド（毎月分配型）日本円コース3,874,449円、ダイワ米国 M L P ファンド（毎月分配型）通貨αコース13,437,960円、ダイワ英国高配当株ソリンα（毎月分配型）98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド98,107円、ダイワ英国高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ1,724,477円、D Cスマート・アロケーション・Dガード95,147円、ダイワ・世界コモディティ・ファンド（ダイワ S M A 専用）274,626円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）南アフリカ・ランド・コース（毎月分配型）98,252円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）トルコ・リラ・コース（毎月分配型）2,554,212円、ダイワ米国高金利社債ファンド（通貨選択型）通貨セレクト・コース（毎月分配型）1,178,976円、ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型）株式αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型）通貨αコース98,203円、ダイワ・オーストラリア高配当株α（毎月分配型）株式&通貨ソリンαコース982,029円、ダイワ米国株ストラテジーα（通貨選択型）ートリプルリターンズ－通貨セレクト・コース（毎月分配型）98,174円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,194円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月10日 至2016年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 17,198,883円
受取利息	△ 3,050,070
その他収益金	744,666
支払利息	△ 14,893,479
(B) 有価証券売買損益	△ 1,077,368
売買益	242,421
売買損	△ 1,319,789
(C) その他費用	△ 139,970
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 18,416,221
(E) 前期繰越損益金	1,530,291,621
(F) 解約差損益金	△ 4,723,800,173
(G) 追加信託差損益金	4,514,120,828
(H) 合計(D + E + F + G)	1,302,196,055
次期繰越損益金(H)	1,302,196,055

(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ひ、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ひ、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。