

ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ

- ダイワファンドラップ TOP I Xインデックス
ダイワファンドラップ 日経225インデックス
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)
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)
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)
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)
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)
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)
ダイワファンドラップ J-R E I Tインデックス
ダイワファンドラップ 外国R E I Tインデックス (為替ヘッジあり)
ダイワファンドラップ 外国R E I Tインデックス (為替ヘッジなし)

運用報告書 (全体版)

第2期

(決算日 2018年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ」は、このたび、第2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/>

<4641>
<4642>
<2731>
<2732>
<2730>
<4643>
<2734>
<2735>
<2733>
<4640>
<2736>
<2737>

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主 要 投 資 対 象	ベビーファンド	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
	トピックス・インデックス・マザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）
マザー ファンドの 運用方法	投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。 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。	
組 入 制 限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無 制 限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分 配 方 針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

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

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2018年6月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ TOPIXインデックス」は、このたび、第2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/>

<4641>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			TOPIX		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	円	税込み 分配金 円	期中 騰落率 %	(ベンチマーク)	期中 騰落率 %			
1 期末(2017年 6 月15日)	11,964	0	19.6	1,588.09	17.7	98.8	1.2	4,959
2 期末(2018年 6 月15日)	13,726	0	14.7	1,789.04	12.7	98.7	1.2	8,562

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

(注2) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークはTOPIXです。

■基準価額・騰落率

期首：11,964円

期末：13,726円

騰落率：14.7%

■基準価額の主な変動要因

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の受益証券を通じて、わが国の株式に投資した結果、株式市況が上昇したことを反映して、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	円	騰 落 率 %	(ベンチマーク)	騰 落 率 %		
(期首)2017年 6月15日	11,964	—	1,588.09	—	98.8	1.2
6月末	12,161	1.6	1,611.90	1.5	99.1	0.8
7月末	12,213	2.1	1,618.61	1.9	99.1	0.8
8月末	12,206	2.0	1,617.41	1.8	98.9	1.0
9月末	12,732	6.4	1,674.75	5.5	98.7	1.2
10月末	13,419	12.2	1,765.96	11.2	98.3	1.7
11月末	13,617	13.8	1,792.08	12.8	98.7	1.3
12月末	13,821	15.5	1,817.56	14.4	98.8	1.1
2018年 1月末	13,962	16.7	1,836.71	15.7	99.0	1.0
2月末	13,445	12.4	1,768.24	11.3	98.9	1.0
3月末	13,168	10.1	1,716.30	8.1	98.0	2.0
4月末	13,635	14.0	1,777.23	11.9	98.5	1.5
5月末	13,409	12.1	1,747.45	10.0	98.3	1.7
(期末)2018年 6月15日	13,726	14.7	1,789.04	12.7	98.7	1.2

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

投資環境について

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

国内株式市況

国内株式市況は、期首より、欧米の中央銀行の金融引き締めペースの見方が交錯し、横ばい圏で推移しました。2017年8月に入ると、北朝鮮に関わる地政学リスクが高まったことや、米国の物価統計の弱含みにより米国の2017年内の利上げ観測が後退したこと、対米ドルでの円高が進行したことなどが影響し、株価は軟調に推移しました。9月半ば以降は、米国の2017年内の利上げ観測が再び高まり円安米ドル高となったことや北朝鮮問題への懸念が一服したこと、10月に行なわれた衆議院議員選挙で連立与党が勝利したことなどを受け、株価は上昇しました。その後も、堅調な国内企業業績や、米国税制改革法案の議会審議の進展および同法の成立が好感され、株価は上昇しました。しかし、2018年2月に米国長期金利が急上昇したこと、また3月に米国が新たな関税を課す方針を示し貿易摩擦激化への懸念が高まったことにより、株価は下落しました。4月に入ると、米中貿易摩擦懸念の後退や米国金利上昇による円安進行を受け株価は上昇したものの、5月後半には、米国が自動車・同部品への関税引き上げを検討する調査を開始したことや、イタリアにおける政治不安の高まりが懸念され、株価は下落しました。しかし6月に入ると、米国景気への楽観論が広がったことを受けて上昇し、期末を迎えました。

前期における「今後の運用方針」

当ファンド

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

トピックス・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■当ファンド

株式への投資は、「トピックス・インデックス・マザーファンド」の受益証券を組み入れることによって行ないました。

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

期中、資金変動への対応、新規上場等によるTOPIX構成の変化に対応するため、随時、株式の売買を行ないました。

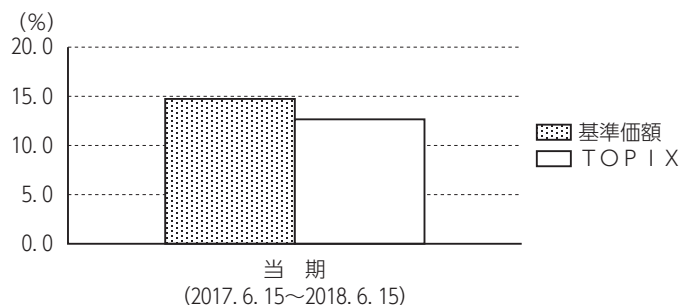
ベンチマークとの差異について

当期のベンチマーク（TOPIX）の騰落率は12.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は14.7%となりました。

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

その他、マザーファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの騰落率とTOPIXの騰落率との差異、先物取引の影響、信託報酬等のコストがかい離の要因として挙げられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2017年6月16日 ～2018年6月15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)	3,726

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



今後の運用方針

■当ファンド

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の受益証券比率を高位に維持します。

■トピックス・インデックス・マザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマーク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 (2017. 6. 16~2018. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	44円	0.335%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は13,146円です。
(投信会社)	(27)	(0.205)	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)	(14)	(0.108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(3)	(0.022)	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／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物)	(0)	(0.001)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.006	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	45	0.341	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数 千口	金 額 千円	□ 数 千口	金 額 千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	3,923,040	4,221,718	1,384,941	1,485,782

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年6月16日から2018年6月15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	18,152,826千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	138,653,602千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.13

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	8,634	14	0.2	9,518	390	4.1
株式先物取引	20,205	—	—	20,173	—	—
コール・ローン	1,748,896	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合4.8%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2017年6月16日から2018年6月15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
	百万円	百万円	百万円
株式	4	28	305

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2017年6月16日から2018年6月15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	
	百万円	
株式	24	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	73千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B) / (A)	2.0%

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

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

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	当 期 末		
	期 首 口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	5,079,147	7,617,246	8,561,785

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	8,561,785	99.8
コール・ローン等、その他	19,341	0.2
投資信託財産総額	8,581,127	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

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	8,581,127,124円
コール・ローン等	16,120,943
トピックス・インデックス・マザーファンド (評価額)	8,561,785,181
未収入金	3,221,000
(B) 負債	18,823,391
未払解約金	5,545,147
未払信託報酬	13,067,330
その他未払費用	210,914
(C) 純資産総額 (A - B)	8,562,303,733
元本	6,237,886,759
次期繰越損益金	2,324,416,974
(D) 受益権総口数	6,237,886,759口
1万口当り基準価額 (C/D)	13,726円

*期首における元本額は4,145,077,773円、当期中における追加設定元本額は4,087,459,929円、同解約元本額は1,994,650,943円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は13,726円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 7,634円
受取利息	1,062
支払利息	△ 8,696
(B) 有価証券売買損益	678,341,139
売買益	857,574,020
売買損	△ 179,232,881
(C) 信託報酬等	△ 23,108,460
(D) 当期損益金 (A + B + C)	655,225,045
(E) 前期繰越損益金	187,795,983
(F) 追加信託差損益金	1,481,395,946
(配当等相当額)	(234,664,364)
(売買損益相当額)	(1,246,731,582)
(G) 合計 (D + E + F)	2,324,416,974
次期繰越損益金 (G)	2,324,416,974
追加信託差損益金	1,481,395,946
(配当等相当額)	(234,664,364)
(売買損益相当額)	(1,246,731,582)
分配準備積立金	843,028,662
繰越損益金	△ 7,634

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

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

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程 (総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	655,231,694
(c) 収益調整金	1,481,395,946
(d) 分配準備積立金	187,796,968
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,324,424,608
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,324,424,608
(h) 受益権総口数	6,237,886,759口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ TOP I Xインデックス）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2017年9月19日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15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7～11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

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
日本郵政	179.1	238,416	1,331	日本電信電話	56.4	303,984	5,389
シャープ	53.2	204,817	3,849	三菱UFJフィナンシャルG	372.8	277,247	743
キーエンス	3.2	198,637	62,074	KDDI	59.1	178,294	3,016
トヨタ自動車	26.6	188,102	7,071	三井住友フィナンシャルG	33.3	148,072	4,446
SGホールディングス	50.9	124,683	2,449	トヨタ自動車	18.2	124,784	6,856
東海旅客鉄道	5.6	115,872	20,691	ソニー	29.1	124,663	4,283
リクルートホールディングス	42.3	113,477	2,682	ファナック	4.7	117,096	24,914
三菱UFJフィナンシャルG	112.1	80,042	714	野村ホールディングス	178.7	116,441	651
本田技研	20.5	74,724	3,645	信越化学	9.9	109,821	11,093
ソフトバンクグループ	8.1	71,112	8,779	武田薬品	17.4	109,501	6,293

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

組入資産明細表

下記は、2018年6月15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（130,458,954千円）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			日本ハウスHLDGS	17.5	9,642	日清製粉G本社	68.3	163,646	日清食品HD	24.4	202,032
極洋	3.8	14,288	大東建託	22.8	414,732	昭和産業	5.2	15,579	永谷園ホールディングス	8	12,000
日本水産	71.3	38,858	新日本建設	8.6	11,438	中部飼料	7.6	15,686	フジッコ	6.4	18,777
マルハニチロ	12.1	52,695	NIPPO	15.1	31,377	フィード・ワン	44	10,384	ロックフィールド	6.9	13,717
カネコ種苗	5.4	8,586	東亜道路	1.7	6,545	東洋精糖	8.6	10,629	日本たばこ産業	350.7	1,109,965
サカタのタネ	9.5	40,090	前田道路	18.5	40,848	三井製糖	4.8	17,088	ケンコーマヨネーズ	4.3	18,210
ホクト	6.5	12,961	日本道路	1.8	10,800	塩水港精糖	32.5	8,547	わらべや日洋HD	4.1	11,074
鉱業 (0.3%)			東亜建設	5.8	16,663	日新製糖	3.8	8,094	北の達人コーポ	17.7	15,204
日鉄鉱業	2.1	11,634	若築建設	5.3	8,909	森永製菓	13.5	72,360	ユーグレナ	23.2	21,088
三井松島	5	8,015	東洋建設	22.4	11,334	江崎グリコ	16	88,960	理研ビタミン	2.3	10,407
国際石油開発帝石	305.9	359,279	五洋建設	74.1	54,463	不二家	4.3	11,012	繊維製品 (0.7%)		
石油資源開発	9.1	25,516	世紀東急	12.6	9,450	山崎製パン	46.4	130,523	片倉工業	8.2	10,955
K&Oエナジーグループ	4	7,484	福田組	2.4	16,680	モロゾフ	1.7	11,373	グンゼ	4.7	33,887
建設業 (3.1%)			住友林業	38.4	63,744	亀田製菓	3.8	23,218	東洋紡	21.8	40,177
ショーボンドHD	6	45,840	日本基礎技術	19	7,106	寿スピリッツ	5.7	35,226	ユニチカ	18.6	12,276
ミライト・ホールディングス	18.9	33,736	日成ビルド工業	11	13,035	カルビー	26.1	101,398	富士紡ホールディングス	3.6	14,022
タマホーム	10.3	10,876	巴コーポレーション	21.9	11,015	森永乳業	11.5	49,392	倉敷紡績	59	21,358
T A T E R U	6.4	13,811	大和ハウス	187.6	743,458	三井物産	4.2	10,210	シキボウ	6.4	8,422
安藤・間	49.9	48,652	ライト工業	12.3	13,776	ヤクルト	33.5	249,575	日本毛織	16.3	17,881
東急建設	25.5	27,616	積水ハウス	203.9	393,017	明治ホールディングス	37.6	362,088	帝国繊維	6.9	16,332
コムスホールディングス	21.9	64,670	日特建設	10.3	6,427	雪印メグミルク	13.8	41,317	帝人	46.2	96,373
ミサワホーム	7.5	7,342	ユアテック	9.9	9,078	プリマハム	41	26,445	東レ	431	382,641
高松コンストラクショングループ	4.2	13,818	中電工	7.9	23,052	日本ハム	24.5	111,107	サカイオーベックス	3.2	7,392
東建コーポレーション	2.5	24,550	関電工	24.5	30,306	丸大食品	32	15,744	住江織物	2.1	5,991
ヤマウラ	8.4	7,593	きんでん	41.1	74,719	S Foods	4.3	19,156	アツギ	9.8	11,818
大成建設	63.5	391,795	東京エネシス	8.2	10,373	伊藤ハム米久HLDGS	36	34,632	ダイニップ	7.4	7,851
大林組	189.5	216,409	トーエネック	1.9	6,374	サッポロホールディングス	20.9	59,774	セーレン	13.9	26,396
清水建設	194.6	215,811	住友電設	5	9,995	アサヒグループホールディングス	119.4	680,818	ソトー	9.6	10,022
飛鳥建設	77.1	14,957	日本電設工業	9.4	23,114	キリンHD	273	821,457	東海染工	5.5	7,986
長谷工コーポレーション	74.2	119,387	協和エクシオ	22.6	67,212	宝ホールディングス	44.2	64,532	小松精練	11.3	11,390
松井建設	10.5	9,996	九電工	12.6	69,174	オエノンホールディングス	31.1	13,590	ワコールホールディングス	15.4	52,437
鹿島建設	280	251,720	三機工業	13.9	15,276	ココ・コラボトラスJHD	40.3	181,753	ホギメディカル	7.5	37,500
不動テトラ	55	10,945	日揮	54.3	118,428	サントリー食品インター	43.5	213,150	T S Iホールディングス	22.3	18,241
鉄建建設	4.1	12,222	中外炉工業	3.7	10,504	ダイドールグループHD	3.1	19,902	三陽商会	4.9	11,853
西松建設	14.2	45,014	太平電業	4.5	13,680	伊藤園	19.1	100,084	オンワードホールディングス	35	31,325
三井住友建設	45.2	34,623	高砂熱学	17	35,071	キーコーヒー	7	15,372	ゴールドウイン	3.6	34,776
大豊建設	25	16,150	明星工業	12.6	10,609	日清オイログループ	6.6	21,846	デサント	14	28,924
前田建設	45.4	58,384	大気社	7.4	24,531	不二製油グループ	15.4	62,370	パルプ・紙 (0.3%)		
奥村組	9.8	37,093	ダイダ	5	13,495	J-オイルミルズ	3.2	12,768	特種東海製紙	3.4	15,776
東鉄工業	7.9	26,820	日比谷総合設備	7.7	17,063	キッコーマン	43.1	238,774	王子ホールディングス	245	175,175
浅沼組	27	10,530	東芝プラントシステム	13.3	34,500	味の素	129.7	279,827	日本製紙	22.8	42,567
戸田建設	72	71,136	OSJBHD	33.7	9,773	キューピー	31.7	88,664	三菱製紙	14.6	9,475
熊谷組	10.5	40,425	東洋エンジニア	11.4	9,348	ハウス食品G本社	22.1	88,289	北越紀州製紙	31.3	18,498
北野建設	19	7,163	千代田化工建	42.1	38,521	カゴメ	22.9	86,791	中越パルプ	4	7,196
三井ホーム	11	7,843	新興プランテック	13	13,143	アリアケジャパン	5.3	51,834	大王製紙	23	36,570
矢作建設	10.8	9,720	食料品 (4.4%)			ニチレイ	27.2	78,934	レンゴー	56.1	57,165
ピーエス三菱	12.5	7,362	日本製粉	18.4	35,199	東洋水産	30.6	124,389	トーモク	4.2	9,219

銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
ザ・バック	4.4	16,720	コーセー	9.7	249,872	住友理工	9.6	11,222	三協立山	8.2	12,078
化学 (7.4%)			シーズ・ホールディングス	7.5	37,425	三ツ星ベルト	14	19,768	アルインコ	8	8,640
クラレ	97.4	161,002	ポーラ・オルビスHD	24.5	127,890	バンドー化学	11.1	14,962	LIXILグループ	82.1	189,897
旭化成	369.2	533,863	ノビアホールディングス	3.8	31,350	日東紡績	8.7	22,811	日本フイルコン	11.7	7,172
共和レザー	7.8	8,104	エステー	4.7	14,194	旭硝子	56.9	258,041	ノーリツ	12.6	23,788
昭和電工	39.7	196,912	コニシ	9.9	18,552	日本板硝子	28.6	31,631	長府製作所	6.6	15,655
住友化学	432	278,208	長谷川香料	7.9	17,395	日本山村硝子	55	10,120	リンナイ	9.9	101,772
住友精化	2.5	14,475	小林製薬	15.8	157,210	日本電気硝子	24.2	76,956	岡部	12.3	12,386
日産化学	34.3	176,645	荒川化学工業	6.3	12,159	住友大阪セメント	110	58,300	ジーテクト	6.8	13,328
ラサ工業	4	12,420	メック	4.9	10,094	太平洋セメント	35.7	144,763	東プレ	10.4	31,356
クレハ	5.1	37,791	日本高純度化学	4.1	10,106	日本ヒュースム	11.8	10,631	高周波熱錬	11.4	11,764
テिका	5.1	12,984	タカラバイオ	15.1	37,115	日本コンクリート	25.6	9,318	東京製綱	5.1	9,878
石原産業	11.8	13,216	JCU	7.2	19,137	アジアパイルHD	10.7	7,971	バイオラックス	8.7	23,690
日本曹達	40	24,320	新田ゼラチン	10.3	8,672	東海カーボン	52.3	110,928	エイチワン	6.3	8,271
東ソー	85.2	153,956	デクセリアルズ	14.7	16,199	日本カーボン	3.2	21,920	日本発条	54.2	59,023
トクヤマ	17.4	64,641	アース製薬	4.3	24,553	東洋炭素	4.1	14,104	立川プラインド	5.2	7,529
セントラル硝子	11.7	27,822	北興化学	13.2	8,632	ノーリタケ	3.4	17,816	三益半導体	5.5	9,966
東亜合成	33.7	43,911	クミアイ化学	26.6	22,716	TOTO	43.7	246,031	日本製鋼所	18.6	57,102
大阪ソーダ	5.9	18,290	日本農業	15	9,945	日本碍子	66.8	134,401	三浦工業	24.4	69,076
関東電化	15.1	16,066	アキレス	5.3	12,290	日本特殊陶業	47.8	146,029	タクマ	19.5	25,798
デンカ	21.3	82,750	有沢製作所	11.2	13,697	MA R UWA	2.1	19,026	ツガミ	15	16,170
信越化学	98.1	1,023,183	日東電工	42.6	370,875	品川リフラクトリーズ	2.1	8,053	オーグマ	6.2	37,324
日本カーバイド	3.5	7,080	レック	3.6	16,596	黒崎播磨	1.3	8,229	東芝機械	31	17,701
堺化学	4.4	12,786	藤森工業	4.8	18,216	ニッター	10.1	11,625	アマダホールディングス	81.4	92,144
エア・ウォーター	48	101,280	ジェイ エス ピー	3.5	12,057	フジニコポレーテッド	5.4	14,288	アイダエンジニア	13.7	16,097
大陽日酸	45.5	76,713	エフピコ	4.8	30,768	ニチアス	32	45,984	滝澤鉄工	4.8	8,947
日本化学工業	3.4	14,161	天馬	4.7	9,461	ニチハ	8.8	38,412	FUJI	16.4	33,587
日本パーカライズン	29.7	50,222	信越ポリマー	11.8	13,310	鉄鋼 (1.1%)			牧野フライス	27	24,462
高压ガス	11.1	11,211	東リ	22.3	7,871	新日鐵住金	251.7	567,583	オーエスジー	25.3	61,276
四国化成	9.2	14,168	ニフコ	20.5	78,002	神戸製鋼所	102.8	117,397	旭ダイヤモンド	17.7	15,310
戸田工業	2.1	6,092	日本バルカー	4.9	16,145	中山製鋼所	9.1	6,424	DMG 森精機	30.1	50,929
ステラケミファ	3.5	13,650	ユニ・チャーム	119.8	414,747	合同製鐵	3.7	8,436	ソディック	12.8	13,785
保土谷化学	2.4	8,688	医薬品 (4.7%)			JFEホールディングス	149.6	341,237	ディスコ	7.7	153,769
日本触媒	9	74,610	協和発酵キリン	70.6	166,404	日新製鋼	16.1	25,454	日東工器	4	11,076
大日精化	4.8	17,256	武田薬品	208.4	909,666	東京製鐵	30.8	31,015	パンチ工業	6.4	7,705
カネカ	79	84,056	アステラス製薬	579.1	1,023,848	共英製鋼	6.6	14,909	豊和工業	4.3	4,523
三菱瓦斯化学	49.1	133,159	大日本住友製薬	41.5	98,147	大和工業	11.6	41,470	OKK	5.5	6,864
三井化学	53.4	162,603	塩野義製薬	79.1	457,672	東京製鋼	4.5	7,524	石川製作所	2.1	4,204
JSR	59.5	114,299	田辺三菱製薬	68	130,220	大阪製鐵	3.8	8,337	東洋機械金属	10	7,220
東京応化工業	10.3	43,569	あすか製薬	7.2	9,374	淀川製鋼所	7.3	21,228	島精機製作所	7.2	39,384
大阪有機化学	6.2	9,548	日本新薬	14.9	112,197	東洋鋼鈑	14.9	10,683	オプトラン	5.2	21,294
三菱ケミカルHLDGS	395.6	383,811	中外製薬	59.1	355,782	丸一鋼管	19.3	72,664	ヤマシンフィルタ	9.5	10,925
KIノオケム	9.4	30,926	科研製薬	10	58,500	大同特殊鋼	9.7	51,604	日阪製作所	10.3	10,835
ダイセル	78.2	95,795	エーザイ	68	555,832	愛知製鋼	7.5	6,247	やまびこ	10.9	15,794
住友ベークライト	47	50,290	ロート製薬	30.8	109,032	日立金属	60.7	73,325	平田機工	2.1	15,603
積水化学	121.3	225,132	小野薬品	134.8	360,320	日本金属	2.5	5,035	ナプテスコ	30.6	104,805
日本ゼオン	49.4	68,517	久光製薬	16.6	159,194	大平洋金属	3.8	15,162	三井海洋開発	5.8	16,837
アイカ工業	16	64,800	持田製薬	3.8	31,008	新日本電工	36.5	12,008	レオン自動車	5.6	12,180
宇都興産	29.7	91,624	参天製薬	107	220,313	栗本鉄工所	3.9	7,686	SMC	17.8	696,870
積水樹脂	9.3	22,487	扶桑薬品	3.7	11,003	三菱製鋼	5.8	13,258	ホソカワミクロン	2.4	17,616
タキロンシーアイ	14.8	9,812	日本ケミファ	1.7	7,956	日本精練	1.6	7,128	ユニオンツール	3	11,400
旭有機材	5.6	12,583	ツムラ	20	78,100	シンニッタン	19.4	9,409	オイレス工業	7.1	16,514
日立化成	28.6	67,867	日医工	14.3	24,281	非鉄金属 (0.9%)			日精工エスビー	2	11,880
ニチパン	3.4	10,200	キッセイ薬品工業	10.1	31,360	大紀アルミニウム	11.9	8,710	サトーホールディングス	7.8	25,077
リケンテクノス	16.4	9,446	生化学工業	11.9	18,683	日本軽金属HD	161.3	40,970	技研製作所	3.9	10,171
大倉工業	16	8,496	栄研化学	9.4	23,960	三井金属	15.2	78,280	日精樹脂工業	6.4	8,102
積水化成成品	9.2	11,233	鳥居薬品	3.7	10,511	東邦亜鉛	3.4	14,739	小松製作所	273.4	927,646
群栄化学	2.3	8,349	JCRファーマ	4.1	29,233	三菱マテリアル	36.1	113,534	住友重機械	31.5	120,960
ダイキョーニシカワ	11.8	20,390	東和薬品	2.7	17,253	住友鉱山	71.7	330,537	日立建機	26.4	98,208
竹本容器	3.5	10,902	富士製薬工業	2.2	9,108	DOWAホールディングス	14	51,030	巴工業	4.5	10,224
日本化薬	36.9	44,206	沢井製薬	11.3	56,500	古河機金	9.6	15,696	井関農機	6.1	12,462
カールットホールディングス	12.5	12,812	ゼリア新薬工業	12.2	27,999	大阪チタニウム	6.6	11,213	TOWA	5.4	6,998
日本精化	9.2	11,408	第一三共	162.1	651,155	東邦チタニウム	11.4	11,457	丸山製作所	5	9,135
扶桑化学工業	5.8	16,634	キョーリン製薬HD	14.7	34,456	UACJ	8.5	21,921	北川鉄工所	3.4	9,370
ADEKA	24.5	46,648	大幸薬品	4.2	9,038	古河電工	18.8	75,952	ローツェ	3.3	8,045
日油	22.7	78,428	ダイト	3.9	14,508	住友電工	207.7	351,532	クボタ	302.9	558,244
ハリマ化成グループ	6.9	6,292	大塚ホールディングス	117.5	643,195	フジクラ	67	50,652	三菱化工機	3.5	7,392
花王	139.3	1,204,527	大正製薬HD	12.5	154,625	昭和電線	9.9	7,999	月島機械	11.8	20,520
第一工業製薬	14	10,724	ベプテドリーム	26.1	126,976	タツタ電線	12.7	7,950	帝国電機製作所	6.3	8,977
三洋化成	3.6	18,252	石油・石炭製品 (0.7%)			リヨービ	6.9	25,081	新東工業	14.3	14,571
大日本塗料	8.7	13,380	昭和シェル石油	52.4	84,206	アーレステイ	8.7	9,143	渋谷工業	5.2	18,278
日本ペイントHOLD	46.1	216,670	ニチレキ	8.7	10,727	アサヒHD	10.3	21,866	アイテコーポレーション	9.9	7,078
関西ペイント	62.4	141,710	ユシロ化学	5.3	8,755	金属製品 (0.6%)			小森コーポレーション	13.7	18,686
中国塗料	17.8	18,992	ビーピー・カストロール	3.3	5,553	宮地エンジニアリングG	2.7	5,756	鶴見製作所	5	9,430
日本特殊塗料	4.7	11,364	富士石油	16.7	6,462	トーカロ	16.5	21,697	住友精密	27	10,098
藤倉化成	12.4	8,494	MORESCO	4.5	8,514	アルファCO	2.9	4,848	酒井重工業	1.8	7,029
太陽ホールディングス	4.4	20,504	出光興産	47.6	179,928	SUMCO	52.4	123,087	荏原製作所	23.1	81,427
DIC	22.7	82,287	JITGホールディングス	896.8	685,155	川田テクノロジーズ	1.4	10,892	西島製作所	8	8,256
サカタインクス	13.7	20,878	コスモエネルギーHLDGS	16.5	60,885	東洋製糖グループHD	36.9	69,003	北越工業	7.7	8,285
東洋インキSCホールディン	54	32,724	ゴム製品 (0.8%)			ホクサンホールディングス	19	7,030	ダイキン工業	77.4	1,029,033
T&K TOKA	5.7	6,999	横浜ゴム	31.3	75,495	横河ブリッジHLDGS	10.8	28,695	オルガン	2.8	8,638
富士フイルムHLDGS	116.7	503,210	東洋ゴム	33.6	56,212	駒井ハルテック	3.1	7,371	トーヨーカネツ	2.7	10,165
資生堂	105.8	951,459	ブリヂストン	187.1	827,730	三和ホールディングス	52.7	63,714	栗田工業	30	91,800
ライオン	79.3	168,988	住友ゴム	57.9	107,578	文化シヤッター	17.6	17,899	椿本チエイン	31	27,311
高砂香料	3.5	13,177	オカモト	20	25,120			アネスト岩田	10.3	11,700	
マンダム	10.6	37,842	ニッタ	5.6	24,220			ダイフク	29	149,930	
ミルボン	7.7	39,039						加藤製作所	3.2	9,232	
ファンケル	13.8	78,936									

銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
油研工業	3.5	9,800	能美防災	8.1	20,355	東京エレクトロン	37.9	723,132	アジアールインターナショナル	12.6	51,786
タダノ	27.2	39,358	ホーチキ	5.1	11,107	輸送用機器 (8.8%)			タカラトミー	24.8	23,708
フジテック	17.3	24,877	エレコム	5.3	14,341	トヨタ紡織	16.5	35,211	大建工業	5.2	13,603
C K D	16	32,432	パナソニック	646.5	1,012,419	ユニプレス	10.8	25,434	凸版印刷	155	139,035
キトー	5.3	12,820	シャープ	53.2	149,119	豊田自動織機	45.7	296,593	大日本印刷	7.2	177,768
平和	17.7	46,427	アンリツ	41.6	64,480	モリタホールディングス	9.2	20,994	共同印刷	2.5	7,420
理想科学工業	6	13,542	富士通ゼネラル	17.8	29,904	三桜工業	9.9	7,335	N I S S H A	12	27,000
S A N K Y O	13.4	59,898	ソニー	379.3	2,065,288	デンソー	125.9	696,856	宝印刷	6.9	12,930
日本金銭機械	6.8	8,676	T D K	29.4	337,806	東海理化電機	13.5	28,566	アシックス	56.3	99,256
マースエンジニアリング	4.1	10,832	帝国通信工業	7.1	9,407	三井E&SHD	20.1	29,727	ヤマハ	38.4	228,096
福島工業	3.6	18,216	タムラ製作所	23.2	17,632	川崎重工業	43.5	148,552	河合楽器	3.3	18,183
ダイコク電機	4.2	8,064	アルプス電気	48.5	135,897	名村造船所	19.5	9,574	クリナップ	8.3	7,046
竹内製作所	9.4	22,419	池上通信機	40	6,240	日本車輛	26	7,358	ビジョン	34.2	189,126
アマノ	17.8	47,846	パイオニア	100.2	16,132	三菱ロジスネクスト	7.2	8,920	キングジム	10.1	11,130
J U K I	8.8	10,463	日本電波工業	13.4	8,241	日産自動車	664.2	724,642	リンテック	12.5	40,125
サンデンホールディングス	8.1	12,546	日本トリム	1.5	7,177	いすゞ自動車	163.9	250,111	イトーキ	15.8	10,396
マックス	8.8	12,988	ローランドディー. ジー.	3.6	9,050	トヨタ自動車	688.4	2,055,680	任天堂	34.9	1,317,824
グロリー	16.7	53,607	フオスター電機	7	11,753	日野自動車	80.9	97,969	三菱鉛筆	9.3	20,934
新晃工業	6.3	12,070	クラリオン	33	9,504	三菱自動車工業	210	185,220	タカラスタンダード	11.7	21,960
大和冷機工業	10.1	13,079	S M K	18	7,164	エフテック	5.4	8,062	コクヨ	27	54,054
セガサミーホールディングス	56	110,152	ヨコオ	4.7	10,222	武蔵精密工業	6.3	25,452	ナカバヤシ	13.3	9,828
日本ピストンリング	4	9,356	ホシデン	14.5	14,746	日産車体	22.3	22,991	グロープライド	4.1	17,609
リケン	2.7	16,092	ヒロセ電機	9.2	134,136	新明和工業	24.1	31,474	オカムラ	19.9	32,198
T P R	6.3	17,917	日本航空電子	14	25,130	極東開発工業	10.3	17,437	美津濃	5.7	23,569
ツバキ・ナカシマ	6	15,936	T O A	7.4	8,717	日信工業	11.7	24,102	電気・ガス業 (1.7%)		
ホンザキ	17.9	206,029	マフセルホールディングス	11.2	19,992	トピー工業	4.8	15,360	東京電力HD	452.7	229,518
大豊工業	5.1	6,757	古野電気	9.6	9,100	ティラド	2.4	8,952	中部電力	174.4	295,695
日本精工	115.1	136,969	ユニデンホールディングス	24	8,256	曙ブレーキ	30.2	10,298	関西電力	231.7	376,512
N T N	125.4	58,436	アルパイン	13.4	27,992	タッチエス	9.7	18,818	中国電力	73.7	107,602
ジェイテクト	58.2	91,781	スマグコーポレーション	7	8,785	N O K	27.8	58,102	北陸電力	55.9	64,788
不二越	5.2	26,884	アイコム	3.9	10,608	フタバ産業	19.2	15,014	東北電力	134.1	184,253
日本トムソン	19.8	18,295	リオン	3.6	8,272	K Y B	5.9	31,093	四国電力	50.9	80,931
T H K	35.3	123,550	本多通信工業	6.7	6,432	大同メタル工業	8.1	9,355	九州電力	124.4	156,992
ユーシン精機	5.9	8,342	船井電機	9.5	6,365	プレス工業	30.5	19,794	北海道電力	56.7	43,659
イブグル工業	7	12,733	横河電機	56.3	113,050	太平洋工業	13.2	23,799	沖縄電力	11.8	27,069
日本ペーパー工業	7.2	11,368	新元元工業	2.1	12,117	ケーヒン	12.8	29,376	電源開発	44.6	129,250
キッツ	25.2	23,713	アズビル	16.6	88,478	河西工業	8.1	12,028	イーレックス	10.7	12,604
マキタ	73.7	378,081	日本光電工業	24.1	73,625	アイシン精機	46.8	261,612	東京瓦斯	120.9	362,035
日立造船	42.5	22,567	共和電業	19.5	8,658	マツダ	176.8	251,940	大阪瓦斯	108.9	256,296
三菱重工業	94	390,664	堀場製作所	11.3	93,225	今仙電機製作所	7.6	9,576	東邦瓦斯	28.2	107,019
I H I	43.2	176,040	アドバンテス	32.2	74,768	本田技研	508.9	1,797,943	北海道瓦斯	39	12,051
スター精密	9.3	16,730	エスベック	5.4	11,885	スズキ	112.4	722,507	西部瓦斯	6.8	20,604
電気機器 (13.6%)			キーエンス	27.8	1,878,168	SUBARU	176.1	596,802	静岡ガス	16.6	17,944
日清紡ホールディングス	34.4	43,068	日置電機	3.6	16,740	安永	3.3	6,860	メタウオーター	3.2	10,032
イビデン	34.3	62,426	シスメックス	44.1	458,199	ヤマハ発動機	79.5	240,090	陸運業 (4.4%)		
ユニカミノルタ	129.5	137,529	日本マイクロニクス	11.9	12,185	ショーワ	15.2	31,403	東武鉄道	59	212,695
ブラザー工業	69	158,493	メガチップス	4.9	14,587	T B K	22.4	12,185	相鉄ホールディングス	17.5	61,425
ミネベアミツミ	105.1	205,470	OBARA GROUP	3.3	20,592	エクセディ	6.6	23,958	東京急行	153.2	310,842
日立	1,362	1,113,979	コーセル	8.8	12,135	豊田合成	10.9	57,530	京浜急行	78.4	153,350
三菱電機	567.3	862,863	イリソ電子工業	4.8	32,832	愛三工業	10.7	11,106	小田急電鉄	83.2	205,920
富士電機	170	145,690	オプテックスグループ	9.6	28,704	ヨロズ	6.6	11,662	京王電鉄	31.4	171,444
東洋電機製造	3.6	6,840	千代田インテグレ	3	7,095	エフ・シー・シー	9.3	29,248	京成電鉄	39.1	154,640
安川電機	66	276,870	レーザータック	12.4	40,052	シマノ	22.7	374,777	富士急行	8.2	28,782
ジフオニアテクノロジー	40	16,240	スタンレー電気	43	169,635	テイ・エス テック	13.1	63,207	東日本旅客鉄道	102.2	1,132,376
明電舎	49	19,992	岩崎電気	5.1	8,501	ジャムコ	3.1	7,402	西日本旅客鉄道	51.1	419,122
オリシオ電気	4	9,928	ウシオ電機	32.3	45,478	精密機器 (1.7%)			東海旅客鉄道	50.8	1,220,216
山洋電気	2.8	25,004	ヘリオステクノH	8.7	6,377	テルモ	86.8	583,296	西武ホールディングス	71.7	139,671
デンソー	5.6	10,740	日本セラミック	5.9	17,788	日機装	20.1	24,019	鴻池運輸	8.2	14,473
東芝テック	40	26,800	古河電池	6.3	5,777	島津製作所	67.6	211,926	西日本鉄道	15.3	47,812
マプチモーター	15	76,800	山一電機	4.8	8,001	長野計器	7.5	10,057	ハマキョウレックス	4.5	16,087
日本電産	68.3	1,186,371	図研	5.1	9,338	ブイ・テクノロジ	1.4	31,570	サカイ引越センター	3.2	18,464
東光高岳	3.9	7,601	日本電子	22	25,014	東京計器	5.3	6,635	近鉄グループHDGS	52.2	247,428
ダブル・スコープ	8.9	16,812	カシオ	45.5	77,486	東京精密	10.2	40,953	阪急阪神HDGS	71.3	339,031
ダイハチ	31	22,568	ファナック	53.8	1,217,494	マニー	6.9	36,087	南海電鉄	25.2	81,774
ヤーマン	8.6	17,114	日本シイエムケイ	12	8,916	ニコン	96.1	173,172	京阪ホールディングス	23.7	95,155
J V Cケンウッド	46.8	15,584	エンプラス	2.8	8,960	トプコン	30.3	59,842	名古屋鉄道	42.4	128,684
第一精工	3.4	7,106	大真空	4.1	5,953	オリンパス	84.1	347,333	山陽電鉄	5	13,770
日新電機	13.6	15,517	ローム	25.4	244,602	理研計器	5.9	15,275	日本通運	20.9	187,264
大崎電気	14.1	12,196	浜松ホトニクス	40.1	188,871	タムロン	4.7	9,691	ヤマトホールディングス	94.5	323,190
オムロン	59.9	331,247	三井ハイテック	8.4	11,894	HOYA	113.9	732,718	山九	13.7	86,036
日東工業	10.1	20,654	新光電気工業	22	21,824	ノーリツ鋼機	6.2	12,319	丸全昭和運輸	22	11,572
I D E C	7.5	21,142	京セラ	93	608,220	イー・アンド・デイ	11	12,221	センコーグループHDGS	32.6	30,122
ジーエス・ユアサコーポ	102	51,612	太陽誘電	24.7	72,494	リズム時計	66.1	48,253	トナミホールディングス	1.6	11,776
メルコホールディングス	3.1	12,880	村田製作所	59.3	1,081,632	シズム時計	4	9,488	ニッコンホールディングス	18.8	57,904
日本電気	72.8	227,500	ユーシン	15.5	11,253	メニコン	8.4	25,284	福山通運	8.2	48,216
富士通	584	413,647	双葉電子工業	8.8	17,696	セイコーHD	8.5	21,564	セイノーホールディングス	40	85,680
沖電気	22.4	28,067	北陸電気工業	5.3	6,937	ニプロ	39	51,402	日立物流	12	36,120
電気興業	3.9	13,201	ニチコン	17.1	24,367	その他製品 (2.1%)			丸和運輸機関	3.2	12,864
サンケン電気	34	20,672	日本ケミコン	4.7	19,998	パラマウントベッドHD	6	28,950	九州旅客鉄道	44.9	161,191
アイホン	4.9	8,638	K O A	8.1	21,667	S H O - B I	13.7	6,110	SGホールディングス	50.9	126,690
ルネサスエレクトロニクス	32.4	35,931	市光工業	9.6	14,284	ニホンフラッシュ	4.4	12,685	海運業 (0.2%)		
セイコーエプソン	84.8	164,851	小糸製作所	34.3	268,226	前田工業	7	13,706	日本郵船	44.3	103,662
ワコム	45.3	28,720	ミツバ	11.6	12,493	アートナイチャー	9	6,453	商船三井	33.8	99,372
アルバック	13.1	61,701	SCREENホールディングス	10.9	93,958	パンダダイナムコHDGS	58.5	270,270	川崎汽船	24.7	56,093
E I Z O	5.4	25,272	キャノン電子	5.6	13,372	S H O E I	2.8	11,284	NSユナイテッド海運	2.6	5,655
ジャパンディスプレイ	121.1	18,043	キャノン	303.4	1,138,356	パイロットコーポレーション	9.9	63,360	飯野海運	28.9	14,854
日本信号	15.9	17,394	リコー	171.4	173,799	萩原工業	5.2	9,718	空運業 (0.6%)		
京三製作所	17	14,093	象印マホービン	10.3	16,366	トッパン・フォームズ	12.2	13,773	日本航空	99.4	426,823

銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
ベルク	2.7	16,146	ジャフコ	7.9	37,762	エフ・ジェー・ネクスト	7.6	8,215	よみうりランド	1.6	7,624
ファーストリテイリング	7.4	379,990	大和証券G本社	470.7	305,437	グランディハウス	19.2	9,849	東京都競馬	4.4	20,834
サンドラッグ	23.8	115,787	野村ホールディングス	959	542,985	日本空港ビルデング	16.2	91,044	常磐興産	6.5	12,103
サックスホールディング	6.7	6,753	岡三証券グループ	46	25,944	サービスマ (4.6%)			カナモト	8.3	29,589
ペルーナ	14.2	21,456	丸三証券	19.4	19,749	日本工営	4.1	12,669	東京ドーム	22.4	22,310
銀行業 (6.8%)			東洋証券	38	9,956	LIFULL	20.1	14,853	西尾レントオール	5.7	20,748
じもとホールディングス	55.2	9,825	東海東京HD	58.7	43,614	ジェイシーリゾートメント	4.9	10,745	トランス・コスモス	6.5	17,465
めがきフィナンシャルG	286.3	112,515	水戸証券	26.2	10,558	日本M&Aセンター	38.1	134,493	乃村工藝社	13	32,422
東京きらぼしFG	7.6	19,904	いちよし証券	13.6	17,231	タケエイ	8.3	10,076	藤田観光	2.8	9,730
九州フィナンシャルG	89	48,327	松井証券	24.5	25,872	トラスト・テック	3	11,805	KNT-CTホールディングス	4.3	7,043
ゆうちょ銀行	161.7	217,324	マネックスG	60.4	35,938	コジダホールディングス	14.7	24,710	日本管財	6.1	14,023
富山第一銀行	19.1	9,588	カブドットコム証券	35.6	13,706	パソナグループ	5.7	10,014	トーカイ	5.4	13,008
コソディア・フィナンシャル	333.9	214,029	極東証券	8.2	12,234	C D S	6.6	9,537	セコム	57.3	473,871
西日本フィナンシャルHD	36	47,232	岩井コスモホールディング	7.9	11,636	リンクアンドモチベーション	11.1	15,828	セントラル警備保障	3.5	16,520
関西みらいFG	26.5	23,267	藍澤證券	14.1	11,294	G C A	8.6	7,937	丹青社	12.4	18,848
33FG	7.5	17,070	保険業 (2.3%)			エス・エム・エス	11	46,860	メイテック	6.3	31,878
新生銀行	49	86,191	かんぽ生命保険	21.7	53,360	パルティホールディングス	50.5	124,634	応用地質	6.9	10,315
あおぞら銀行	33.2	145,914	SOMPOホールディングス	109.7	506,046	リニカル	5.3	11,861	船井総研ホールディング	11.9	32,034
三菱UFJフィナンシャルG	913.8	2,578,020	アニコムホールディングス	4.1	18,060	クックパッド	19.1	10,925	オオバ	18.8	11,994
りそなホールディングス	611.7	399,501	MS & AD	145.3	517,122	スタジオアリス	3.3	8,692	学究社	5.5	10,186
三井住友トラストHD	109.7	506,265	S O N Y F H	45.3	96,489	シミッドホールディングス	4.8	11,246	ベネッセホールディングス	19.5	81,120
三井住友フィナンシャルG	422.1	1,911,268	第一生命HLDGS	315.1	652,257	総合警備保障	21.6	114,264	イオンディライト	6.8	27,030
第四銀行	6.5	31,005	東京海上HD	209.9	1,169,982	カカコム	41.3	104,902	ニチイ学館	11.7	15,221
北越銀行	5.9	14,366	T&Dホールディングス	170.4	299,478	ディップ	7.9	22,372	ダイセキ	9.4	31,678
千葉銀行	196	169,540	アドバンスクリエイト	4.3	9,309	オプトホールディング	5.8	12,951			
群馬銀行	107.5	68,585	その他金融業 (1.2%)			ツヅイ	14.7	13,759			
武蔵野銀行	8.4	30,450	全国保証	15.9	82,521	エムスリー	57.4	266,623			
千葉興業銀行	21.9	11,125	アルヒ	6.1	13,694	アウトソーシング	17.1	36,576			
筑波銀行	33.8	9,666	クレディセゾン	41.4	73,443	ウエルネット	7.7	9,286			
七十七銀行	16.3	42,314	芙蓉総合リース	6.4	50,688	ワールドホールディングス	2.1	7,255			
青森銀行	4.7	16,144	興銀リース	10.5	31,552	ディー・エヌ・エー	29.4	62,739			
秋田銀行	3.7	11,895	東京センチュリー	11.5	75,555	博報堂DY HLDGS	74.8	136,136			
山形銀行	6.2	15,332	日本証券金融	23.7	14,978	ぐるなび	10.4	9,921			
岩手銀行	3.6	15,894	アイフル	97.5	34,417	ファンコミュニケーションズ	18.3	13,761			
東邦銀行	47.2	20,107	リコーリース	4.3	16,017	WDBホールディングス	3	9,720			
東北銀行	8.9	12,513	イオンフィナンシャルサービス	39.3	98,760	ティア	10.3	11,185			
ふくおかフィナンシャルG	224	135,296	アコム	116.5	51,027	バリューコマース	7.6	11,194			
静岡銀行	143.7	157,638	ジャックス	7.2	17,546	インフォマート	28.9	44,881			
十六銀行	6.8	20,740	オリコ	123.9	19,080	JPホールディングス	21.5	8,514			
スルガ銀行	58.4	61,670	日立キャピタル	15	43,800	EPSホールディングス	8.9	21,938			
八十二銀行	93.8	47,369	アプラスフィナンシャル	66.6	7,326	プレステージ・インター	12.6	20,487			
山梨中央銀行	37	17,575	オリックス	372.4	693,781	アマーズ	4	12,220			
大垣共立銀行	8.3	24,335	三菱UFJリース	139.7	99,047	ドリームインキュベータ	3	7,182			
福井銀行	5	12,500	日本取引所グループ	161.5	351,908	クイック	4.3	7,967			
北國銀行	6.2	29,946	イー・ギャランティ	4.8	10,920	T A C	23.5	8,060			
清水銀行	3	6,618	NECキャピタルソリューション	3.5	7,070	ケネディクス	74.3	50,895			
滋賀銀行	46	27,416	不動産業 (2.5%)			電通	66.3	348,738			
南都銀行	6.3	18,799	いちご	81	43,659	ぴあ	2.1	13,482			
百五銀行	50	23,550	日本駐車場開発	82.9	15,170	イオンファンタジー	2	13,780			
京都銀行	21	116,340	ヒューリック	117.2	139,936	ネクシイズグループ	2.8	4,734			
紀陽銀行	19.8	37,679	三栄建築設計	3	5,772	みらかホールディングス	15.6	50,934			
ほくほくフィナンシャルG	34.7	56,248	野村不動産HLDGS	37.6	95,804	アルプス技研	5.7	14,033			
広島銀行	78.3	63,266	三重交通グループHD	14.6	7,431	オリエンタルランド	64.1	766,636			
山陰合同銀行	31.2	32,541	サムディ	5.8	13,195	ダスキン	14.2	39,561			
中国銀行	36.8	46,809	日本商業開発	4.6	8,970	明光ネットワークジャパン	7.8	9,906			
伊予銀行	76	60,496	プルサスコポレーション	8.4	15,128	ファルコホールディングス	7.1	13,482			
百十四銀行	58	22,040	ユニオンホールディングス	7.3	15,899	ラウンドワン	17.4	32,103			
四国銀行	9	13,194	日本管理センター	5.4	7,435	リゾートトラスト	22.8	47,059			
阿波銀行	43	32,035	フージャースHD	17.1	14,039	ビー・エム・エル	7.5	21,892			
大分銀行	3.4	13,311	オーブンハウス	9.4	64,202	りらいあコミュニケーション	9.6	15,715			
宮崎銀行	3.9	14,254	東急不動産HD	134	107,334	リソー教育	10.6	8,755			
佐賀銀行	3.8	9,614	飯田GHHD	46.2	100,947	ユー・エス・エス	65.7	141,189			
十八銀行	38	11,590	パーク24	32.3	96,706	サイバードエージェント	34.7	230,061			
沖縄銀行	5.2	22,698	バラカ	3	7,575	楽天	278.9	202,927			
琉球銀行	10.8	18,781	三井不動産	280	767,900	テー・オー・ダブリュー	10.2	9,016			
セブン銀行	208	72,384	三菱地所	416.6	851,113	セントラルスポーツ	2.4	9,756			
みずほフィナンシャルG	581.8	1,454,947	平和不動産	10.1	22,644	フルキャストホールディングス	5.5	15,537			
高知銀行	8.6	10,775	東京建物	61	94,184	テクノプロ・ホールディング	10.4	75,712			
山口フィナンシャルG	63	83,979	ダイビル	14.6	16,979	イー・ガーディアン	3.3	11,071			
名古屋銀行	4.1	16,687	京阪神ビルディング	12.2	12,200	ジャパンマテリアル	16.1	28,980			
北洋銀行	78.5	30,536	住友不動産	135	577,800	ベクトル	7.1	16,436			
愛知銀行	2.3	12,213	大京	9	22,527	アサンテ	4.3	9,348			
中京銀行	3.1	7,266	テアオーシー	20.6	17,551	N・フィールド	3.8	6,460			
大光銀行	3.8	8,683	レオパレス21	67.5	45,090	M&Aキャピタルパートナー	1.4	14,896			
愛媛銀行	9.1	11,739	スターツコーポレーション	7.8	21,434	エスコローA J	11.1	5,383			
トマト銀行	8.3	12,989	フジ住宅	11.7	11,547	日本ビューホテル	8.7	12,684			
京葉銀行	45	22,545	空港施設	11.1	7,048	リクルートホールディングス	418.5	1,331,667			
栃木銀行	29.1	11,989	ゴールドフレスト	5	9,545	日本郵政	307.8	382,595			
北日本銀行	3.4	9,537	日本エスリード	3.4	6,820	ベルシステム24HLDGS	10	19,320			
東和銀行	10.9	13,319	日神不動産	9.6	6,950	ソラスト	3.8	13,585			
福島銀行	13.5	10,152	日本エスコ	11.8	7,976	リログループ	30.3	89,263			
大東銀行	8.3	10,956	タカラレーベン	28	11,760	東祥	3.7	15,688			
トモニホールディングス	45.4	23,063	サンヨーハウジング名古屋	8	9,808	エイチ・アイ・エス	8.4	30,492			
フィデアホール	63.5	11,049	イオンモール	36.1	74,943	共立メンテナンス	9.7	60,334			
池田泉州HD	52.1	20,579	カチダス	7.4	33,485	イネンホールディングス	7.7	11,118			
証券・商品先物取引業 (0.9%)			トーセイ	8.4	11,533	建設技術研究所	7.9	11,289			
F P G	20.8	31,740	エヌ・ティ・ティ都市開発	34.9	42,612	スバル興業	1.1	7,194			
SBIホールディングス	64.1	194,864	サンヨロンティア不動産	9.1	12,239	東京テアトル	5.6	8,103			

銘柄	株数	金額
合計	68,591	144,768,159
銘柄数<比率>	1,499銘柄	<98.7%>

(注1) 銘柄欄の () 内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 合計欄の < > 内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2018年6月15日現在	
	買建額	売建額
国内 TOPIX	百万円 1,804	百万円 —

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入状況

区分	2018年6月15日現在	
	貸付	借入
株式	株 3,980,000 (465,200)	株 — (—)

(注1) () 内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

(注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券へ465,200株を貸付けています。

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第29期 (決算日 2017年9月19日)

(計算期間 2016年9月21日～2017年9月19日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	東京証券取引所第一部上場株式(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

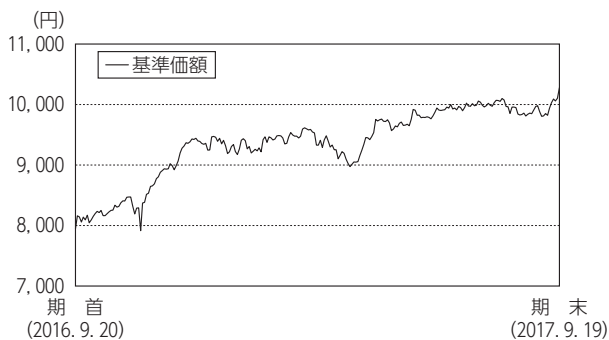
大和投資信託

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		TOPIX		株式組入比率	株式先物比率
	円	%	(ベンチマーク)	%		
(期首)2016年9月20日	7,944	—	1,316.97	—	99.7	0.2
9月末	8,045	1.3	1,322.78	0.4	98.5	1.5
10月末	8,471	6.6	1,393.02	5.8	98.6	1.4
11月末	8,937	12.5	1,469.43	11.6	99.0	0.9
12月末	9,248	16.4	1,518.61	15.3	99.4	0.6
2017年1月末	9,267	16.7	1,521.67	15.5	99.4	0.5
2月末	9,358	17.8	1,535.32	16.6	99.5	0.7
3月末	9,298	17.0	1,512.60	14.9	97.4	2.5
4月末	9,420	18.6	1,531.80	16.3	98.4	1.7
5月末	9,649	21.5	1,568.37	19.1	98.6	1.3
6月末	9,926	24.9	1,611.90	22.4	99.1	0.8
7月末	9,971	25.5	1,618.61	22.9	99.1	0.8
8月末	9,968	25.5	1,617.41	22.8	98.9	1.0
(期末)2017年9月19日	10,279	29.4	1,667.88	26.6	99.2	0.7

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：7,944円 期末：10,279円 騰落率：29.4%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、日米の金融政策や米国大統領選挙に関する見方が交錯し、一進一退で推移しました。2016年11月は、米国大統領選挙でのトランプ氏勝利を受けて一時的に投資家のリスク回避姿勢が強まり株価は下落しましたが、その後はトランプ氏の景気刺激政策への期待から、上昇基調となりました。12月半ば以降は、株価の急上昇に対する警戒感に加えてトランプ氏の政策に対する期待と不透明感が交錯し、一進一退で推移しました。2017年4月

に入ると、北朝鮮の地政学リスクの高まりが懸念され、株価は下落しました。しかし4月後半からは、地政学リスク悪化の一巡に加えて、フランス大統領選挙で中道派のマクロン氏が極右政党の候補者を抑えて当選したことが好感されて、株価は上昇しました。6月以降は、欧米の中央銀行の金融引き締めペースの見方が交錯し、株価は横ばい圏で推移しました。8月に入ると、再び北朝鮮に関わる地政学リスクが高まったことや、米国物価統計の弱含みにより米国の年内利上げ観測が後退したこと、また対米ドルでの円高が進行したことなどが影響し、株価は軟調に推移しました。期末にかけては、北朝鮮の地政学リスクがやや後退したことや、衆議院解散観測を受けての安倍政権に対する期待の高まりから上昇しました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

■売買取引および取引の状況

(1)株 式

(2016年9月21日から2017年9月19日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) ()内は株式分割、合併等による増減分、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9月21日から2017年9月19日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 株式先物取引	百万円 16,503	百万円 16,006	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。

■主要な売買取柄

株 式

(2016年9月21日から2017年9月19日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内株式

銘 柄	期 首	当 期 末		銘 柄	期 首	当 期 末		銘 柄	期 首	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				大東建託	24.4	22.7	444,806	昭和産業	27	24	14,880
極洋	35	3.6	12,024	新日本建設	10.7	8.6	7,275	中部飼料	8.5	7.7	15,684
日本水産	77.9	82.7	50,943	NIPPPO	15	13	29,666	フィード・ワン	54.7	49.9	12,874
マルハニチロ	14	12	39,780	東亜道路	27	17	7,089	日本甜菜糖	49	3.6	8,773
カネコ種苗	—	4.4	6,661	前田道路	19	19	43,206	三井製糖	28	4.6	17,480
サカタのタネ	10.7	9.7	30,749	日本道路	20	20	12,280	塩水港精糖	—	29.9	7,534
ホクト	7	5.8	11,263	東亜建設	61	5.8	12,255	日新製糖	—	3.1	6,215
鉱業 (0.3%)				若菜建設	92	53	10,176	森永製薬	61	12.7	82,550
日鉄鉱業	20	1.9	15,390	東洋建設	22.4	17.5	8,522	中村屋	23	1.9	9,633
三井松島	57	6.1	8,936	五洋建設	73.1	69.4	44,971	江崎グリコ	15.1	15.9	89,835
国際石油開発帝石	338.9	327.6	364,127	大林道路	9.1	—	—	不二家	51	4.4	10,846
日本海洋掘削	2.5	3.3	6,860	世紀東急	13.3	13.8	8,735	山崎製パン	48.4	45.6	93,662
石油資源開発	10.2	9.2	20,332	福田組	12	2.2	13,376	第一屋製パン	44	—	—
K&Oエナジーグループ	5.1	4.1	7,605	住友林業	44.6	42.1	70,643	モロゾフ	21	1.4	10,892
建設業 (3.2%)				日本基礎技術	26.2	14.2	5,367	亀田製菓	3.9	3.6	17,532
ショーボンドHD	6.8	5.9	37,465	日成ビルド工業	22	21	12,600	寿スピリッツ	5.7	6.4	23,712
ミライト・ホールディングス	20.4	18.9	24,796	パナホーム	25	—	—	カルビー	24.1	25.8	100,878
タマホーム	—	10.5	7,528	大和ハウス	193	185.5	713,989	森永乳業	59	58	50,054
安藤・間	44.7	47.5	35,530	ライト工業	13.4	12.1	13,382	六甲バター	4	3.5	8,403
東急建設	22	23.1	20,397	積水ハウス	217.3	189.8	354,071	ヤクルト	35.3	34	275,400
コムシスホールディングス	27.1	23.8	60,499	日特建設	18.6	—	—	明治ホールディングス	39.4	37.2	325,128
ミサワホーム	8.9	9.3	8,723	ユアテック	12	11	8,855	雪印メグミルク	15.7	13.8	44,298
高松コンストラクションGP	4.8	4.4	13,332	西部電気工業	—	3.3	8,045	プリマハム	46	44	34,188
東建コーポレーション	2.8	2.5	33,625	中電工	7.5	6.3	19,309	日本ハム	47	45	141,525
大成建設	340	319	373,868	関電工	26	26	30,654	丸大食品	36	29	15,805
大林組	196	188.9	245,570	きんでん	35.1	42.4	74,200	S F o o d s	4.6	3.9	16,614
清水建設	199	193.6	232,126	東京エネシス	8	6.7	7,865	伊藤ハム米久HLDGS	41.9	36.2	37,648
飛島建設	62	71.9	11,360	トーエネック	11	9	5,823	サッポロホールディングス	20.2	20.3	64,757
長谷工コーポレーション	76.8	73.1	103,144	住友電設	6	4.8	9,681	アサヒグループホールディング	122.7	117.7	539,536
松井建設	10.3	8.3	8,026	日本電設工業	9.9	9.5	21,508	キリンHD	281	269.9	683,116
銭高組	18	—	—	協和エグジシオ	25.3	24.1	50,393	宝ホールディングス	47.3	45.5	48,412
鹿島建設	306	277	287,526	九電工	12.2	12.6	55,125	オエノンホールディングス	60	32.6	9,225
不動テトラ	51.3	54.3	9,882	三機工業	14.3	14.1	17,554	コカ・コーラボトラーズJ	22.1	39.5	148,915
鉄建建設	43	40	14,320	日揮	65	58.4	101,148	コカ・コーライーストジャパン	23.2	—	—
西松建設	75	71	43,026	中外炉工業	34	32	7,008	サントリー食品インター	45.5	43	223,600
三井住友建設	255.1	240.9	29,389	太平電業	10	9	12,834	ダイドーグループHD	3.4	2.7	14,580
大豊建設	27	25	12,750	高砂熱学	18.6	17.3	32,420	伊藤園	19.3	18.6	71,331
前田建設	40	42	54,684	明星工業	13.9	13.3	10,001	キーコーヒー	6.7	5.6	12,443
ナカノフドー建設	15.2	—	—	大気社	7.4	7.5	21,832	日清オйлグループ	36	36	26,820
奥村組	58	48	39,696	ダイダン	10	10	13,530	不二製油グループ	17.5	17	51,595
東鉄工業	8	7.8	28,353	日比谷総合設備	8.6	6.3	15,025	J-オイルミルズ	32	2.6	10,517
浅沼組	37	27	8,802	東芝プラントシステム	9.9	10.1	19,594	キッコーマン	49	43.1	151,496
戸田建設	76	74	61,716	OSJBHD	—	27.8	9,007	味の素	138.1	129.3	280,516
熊谷組	97	103	34,711	東洋エンジニア	35	37	10,508	キューピー	33.9	32	85,152
北野建設	33	20	8,840	千代田化工建	47	44	26,928	ハウス食品G本社	21.9	23	80,845
三井ホーム	13	11	7,865	新興プランテック	13.5	13.8	13,496	カゴメ	23.1	22.4	77,504
矢作建設	10.1	10	9,640	食料品 (4.5%)				アリアケジャパン	5.6	5.3	43,566
ピーエス三菱	20.3	14.7	8,981	日本製粉	43	17.4	30,693	ニチレイ	71	29.9	86,411
日本ハウスHLDGS	27.2	17.9	10,185	日清製粉G本社	71	67.2	131,644	東洋水産	31.5	30.3	126,048

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円
日清食品HD	27.2	24.5	171,990	大阪有機化学	—	6.6	9,266	あずか製菓	9.4	6.7	11,591									
永谷園ホールディングス	8	8	10,504	三菱ケミカル HLDGS	403.1	395.1	427,300	日本新薬	14.1	13.7	108,915									
フジッコ	6.9	6	16,410	日本合成化学	15	—	—	中外製薬	61.4	59	274,940									
ロックフィールド	8.4	7	14,476	ダイセル	84.3	78.8	108,901	科研製薬	10.5	10.9	63,547									
日本たばこ産業	361.7	347.1	1,291,212	住友ベークライト	56	51	42,585	エーザイ	75.3	72.2	423,741									
ケンコーマヨネーズ	—	—	11,204	積水化学	136	129.3	284,330	ロート製薬	30.3	28.9	76,007									
わらべや日洋HD	4.1	4.1	11,492	日本ゼオン	51	50	72,500	小野薬品	140	133.4	324,162									
ユーグレナ	22.5	22.3	25,488	アイカ工業	17.6	18.2	67,067	久光製薬	18.9	16.4	87,740									
ミヨシ油脂	95	6.7	9,668	宇部興産	327	295	98,235	持田製薬	4.3	3.6	30,240									
理研ビタミン	—	1.9	8,255	積水樹脂	8.7	8.4	17,774	参天製薬	111.6	105.8	190,757									
繊維製品 (0.7%)				タキロンシニアイ	17	13	8,853	扶桑薬品	28	2.7	7,487									
片倉工業	8.9	7.5	9,997	旭有機材	32	31	9,083	日本ケミファ	13	1.6	8,144									
グンゼ	49	46	24,610	日立化成	29.5	32.4	104,976	ツムラ	19.3	20.1	80,701									
東洋紡	244	231	45,969	ニチパン	9	7	8,057	日医工	14.6	13.6	23,052									
ユニチカ	233	186	15,438	リケンテクノス	13.5	13.6	8,880	キッセイ薬品工業	10.1	10.2	29,314									
富士紡ホールディングス	37	3.3	12,408	大倉工業	20	18	14,490	生化学工業	12.4	10.9	21,353									
倉敷紡績	58	60	17,580	積水化成	18	8.9	11,409	栄研化学	6	5.2	21,580									
シキボウ	121	69	11,040	群栄化学	21	1.9	7,049	日本製薬	—	4.2	5,959									
日本毛織	18.6	15.5	15,376	タイガース ポリマー	—	6.2	4,885	鳥居薬品	4.7	3.9	11,544									
グアスターリミテッド	14.7	20.8	9,152	ダイキョーニシカワ	8.6	10.4	18,075	JCRファーマ	5.4	4.8	14,688									
帝国繊維	7	6.6	15,318	日本化薬	40	37	67,192	東和薬品	3	2.8	14,672									
帝人	248	46.8	107,218	カーリットホールディングス	10.2	16.1	11,930	富士製薬工業	2.7	2.7	10,597									
東レ	439	423.5	459,709	日本精化	7.9	8.3	7,851	沢井製薬	10.4	9.6	59,328									
サカイ オーベックス	58	3.8	8,987	扶桑化学工業	—	4.8	16,944	ゼリア新薬工業	13.1	12.5	25,287									
住江織物	37	22	7,590	ADEKA	27.8	22.8	44,642	第一三共	205.9	171.8	448,398									
芦森工業	47	—	—	日油	46	45	73,215	キョーリン製薬HD	16.1	13.6	30,504									
アツギ	89	76	9,652	花王	155	137.6	941,734	大幸薬品	4.6	4.5	10,242									
セーレン	16.1	15.5	31,666	第一工業製薬	25	19	12,958	ダイト	3.9	3.9	11,220									
ソトエ	—	6.8	7,874	三洋化成	20	3.2	20,384	大塚ホールディングス	131.7	116.3	509,161									
東海染工	—	51	7,191	大日本塗料	43	37	12,802	大正製薬HD	14.5	12.1	105,149									
小松精練	13.2	10.6	9,497	日本ペイント	47.2	45.7	178,687	ペプチドリーム	10.3	22.5	79,312									
ワコールホールディングス	33	33	53,526	関西ペイント	67.9	61.6	173,835	石油・石炭製品 (0.6%)												
ホグメディカル	3.8	3.6	29,520	中国塗料	18	15.8	14,694	日本コークス工業	64.2	65.3	7,313									
TSIホールディングス	27.6	25.4	20,980	日本特殊塗料	6.2	5	9,620	昭和シェル石油	57.8	51.5	62,881									
三陽商会	37	4.4	7,233	藤倉化成	14.5	9.8	6,458	ニチレキ	9	9.2	12,594									
オンワードホールディングス	36	37	30,858	太陽ホールディングス	4.6	4.8	25,824	東燃ゼネラル石油	90	—	—									
ゴールドウイン	2.8	2.6	19,760	DIC	23.7	23	92,000	ユニロ化学	4.8	4.7	7,675									
デサント	14.4	13.5	19,683	サカタインクス	12.9	12.4	25,320	ビービー・カストロール	4.3	—	—									
パルプ・紙 (0.2%)				東洋インキSCホールディングス	57	47	29,986	富士石油	19.5	18.9	7,938									
特種東海製紙	38	3.1	14,198	T&K TOKA	6.2	5.3	6,794	MORESCO	—	4.2	9,042									
王子ホールディングス	229	223	132,685	富士フイルム HLDGS	139	114.8	503,168	出光興産	31.2	36.5	104,937									
日本製紙	31.2	25.6	53,196	資生堂	116.9	105.1	482,409	JXTGホールディングス	712.9	889.3	503,077									
三菱製紙	111	11.2	8,366	ライオン	71	78.9	171,055	コスモエネルギーHLDGS	18.6	17.7	42,462									
北越紀州製紙	39.5	32.9	22,766	高砂香料	4.3	4	15,360	ゴム製品 (1.0%)												
中越パルプ	30	26	5,902	マンダム	5.8	5.8	36,888	横浜ゴム	36.4	32.5	72,962									
巴川製紙	—	24	8,280	ミルボン	3.9	4.1	27,470	東洋ゴム	27.5	33.8	80,883									
大王製紙	27.2	23	30,590	ファンケル	14.2	13.2	32,089	ブリヂストン	206.1	197.7	993,442									
レンゴー	53	53.4	34,176	コーセー	9.9	9.6	131,232	住友ゴム	55.8	54.4	107,984									
トーモク	24	19	7,448	シーズ・ホールディングス	8.4	8.1	31,185	藤倉ゴム	—	10.7	10,079									
ザ・パツク	4.7	4.4	17,644	ポーラ・オルビスHD	6.2	24.8	86,924	オカモト	20	19	22,287									
化学 (7.2%)				ノビアホールディングス	4.1	4.2	26,838	ニッタ	5.9	5	20,175									
クラレ	94.8	98	208,544	コニシ	10.6	9.5	18,971	住友理工	13.3	9.4	10,321									
旭化成	378	365	510,635	長谷川香料	7.9	7.3	15,789	三ツ星ベルト	16	14	18,830									
共和レザー	6.3	6.2	5,834	星光PMC	5.6	4.4	5,319	バンドー化学	25	9.2	11,021									
昭和電工	40.8	39.8	133,927	小林製薬	18.2	15.9	105,417	ガラス・土石製品 (1.0%)												
住友化学	445	430	304,010	荒川化学工業	6.2	5.6	15,388	日東紡績	43	48	31,344									
住友精化	14	2.6	13,598	メック	—	6.3	11,642	旭硝子	301	57.1	237,821									
日産化学	36.7	31.7	129,336	日本高純度化学	3.1	4.3	11,820	日本板硝子	315	25.9	22,015									
ラサ工業	41	57	12,027	タカラバイオ	12.2	17.1	26,111	日本山村硝子	30	41	8,118									
クレハ	45	4.3	24,725	JCI	2.3	4.3	21,134	日本電気硝子	123	24.3	103,275									
テイカ	14	11	11,308	新田セラチン	6.9	8.2	6,199	住友大阪セメント	123	109	54,500									
石原産業	120	11.6	17,980	デクセラリアルズ	17.8	16	23,664	太平洋セメント	379	356	156,284									
日東エフシー	5.8	6	5,268	アース製薬	4.5	4.3	22,059	日本ヒューム	8.1	10.3	6,993									
日本曹達	41	35	23,520	イハラケミカル	10.3	—	—	日本コンクリート	23.9	17.5	7,752									
東ソー	164	171	221,616	北興化学	—	12.9	8,991	アジアパイルHD	16.6	10.8	6,382									
トクヤマ	110	94	48,786	大成ラミック	2.8	3.3	9,784	東海カーボン	54	53	47,700									
セントラル硝子	66	57	28,842	クミアイ化学	13.5	26.3	20,540	日本カーボン	36	3.3	13,860									
東亜合成	37.2	33.2	48,339	日本農薬	15.1	15.6	10,155	東洋炭素	4.1	4	10,744									
大阪ソーダ	28	25	14,325	アキレス	63	5.1	11,541	ノリタケ	37	3.6	20,088									
関東電化	16	12.6	14,338	有沢製作所	11.1	12.7	13,106	TOTO	44.7	42.9	189,403									
デンカ	127	111	81,363	日東電工	47.4	42.2	412,083	日本碍子	77	73.1	155,264									
信越化学	109	105.3	1,069,848	レック	—	4.5	13,342	日本特殊陶業	51.9	50.2	111,695									
日本カーバイド	85	36	8,604	きもと	—	22.5	5,512	MARUWA	2.8	2.4	15,216									
堺化学	28	20	11,020	藤森工業	5.5	4.9	18,571	品川リフラクトリーブ	27	16	5,904									
エア・ウォーター	49	46.8	96,408	前澤化成工業	7.4	8.7	10,848	黒崎播磨	—	16	8,656									
大陽日酸	45.9	44.5	57,138	ジェイ エス ピー	4.3	3	10,230	フジミネコポレテッド	5.7	5.4	14,526									
日本化学工業	32	31	8,308	エフピコ	5.3	5.3	29,733	ニチアス	31	32	42,560									
日本パーカライズング	29.3	29.6	51,800	天馬	5.4	3.7	8,487	ニチハ	8.9	8.4	33,768									
高圧ガス	12	9.2	7,764	信越ポリマー	14.3	12.5	12,787	鉄鋼 (1.3%)												
四国化成	10	9	14,715	東リ	22	23.6	9,510	新日鐵住金	274.3	263.1	713,527									
戸田工業	—	17	8,891	ニフコ	11.6	10.1	69,488	神戸製鋼所	1,107	101.1	135,777									
ステラ ケミファ	4.4	3.1	15,655	日本バルカー	33	5.4	15,530	中山製鋼所	—	6.4	4,742									
保土谷化学	34	2.3	19,849	ユニ・チャーム	124	118.7	308,857	合同製鐵	41	3.9	8,303									
日本触媒	8.8	9.1	74,529	医薬品 (4.5%)				JFEホールディングス	164.7	159.8	357,232									
大日精化	24	24	26,256	協和発酵キリン	73	70	130,480	日新製鐵	27.3	18.2	25,862									
カネカ	82	76	66,044	武田薬品	241.9	219.7	1,360,162	東京製鐵	33.8	31.7	31,002									
三菱瓦斯化学	102	54.9	150,426	アステラス製薬	662.5	572.7	839,578	共英製鐵	7.1	6.6	11,081									
三井化学	259	265	184,175	大日本住友製薬	43.8	40.3	59,603	大和工業	13.3	11.3	35,990									
JSR	56.8	58.4	126,319	塩野義製薬	89.3	74.3	442,753	東京鐵鋼	24	18	7,830									
東京応化工業	12.2	10.9	45,235	田辺三菱製薬	69.8	68.5	185,429	大阪製鐵	4.2	3.6	8,985									

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
淀川製鋼所	9.3	7.6	23.446	千円	新川	11.5	8.2	6,314	千円	富士電機	175	167	104,876	千円
東洋鋼板	17.3	16	8,720		ホンカワミクロン	12	2.6	15,912		東洋電機製造	38	3.8	8,987	
丸一鋼管	20.1	18.7	61,616		ユニオンツール	2.9	2.9	10,353		安川電機	72.2	65.2	235,372	
大同特殊鋼	101	99	64,845		オイルス工業	7.7	6.6	13,477		シンフォニアテクノロジー	47	42	21,294	
日本高周波	64	64	7,360		日精エーエスピー	2.8	—	—		明電舎	56	51	20,553	
日本冶金工業	72.8	56.8	12,836		サトーホールディングス	8.4	7.7	20,674		山洋電気	17	16	21,536	
山陽特殊製鋼	38	36	20,700		日精樹脂工業	7.2	6.5	9,288		デンヨー	6.2	5.6	11,396	
愛知製鋼	38	3	13,290		小松製作所	299.1	270.6	857,260		東芝テック	43	35	21,875	
日立金属	68.7	59.8	92,570		住友重機械	176	170	151,810		芝浦メカトロニクス	—	19	6,669	
大平洋金属	48	43	13,416		日立建機	26.7	26.2	84,757		マブチモーター	16.6	15.4	84,700	
新日本電工	40.4	37.5	17,700		巴工業	3.8	4.8	9,211		日本電産	70.8	72.6	997,524	
栗本鉄工所	35	3.1	7,232		井関農機	66	5.5	13,431		東光高岳	3.4	3.8	7,641	
日本精製管	—	25	4,525		TOWA	8	5.6	9,878		ダブル・スコープ	5.6	8.4	20,437	
三菱製鋼	47	46	13,386		丸山製作所	27	4.6	8,303		ダイヘン	35	32	31,552	
シンニッタン	—	8.8	6,520		北川鉄工所	47	3.4	8,962		田淵電機	16.2	16	4,592	
非鉄金属 (1.0%)					ローツェ	—	3.3	7,758		JVCケンウッド	47.7	43.9	13,960	
大紀アルミニウム	—	15	12,270		クボタ	293.8	301.6	607,422		第一精工	3.8	—	—	
日本軽金属HD	145.9	146.2	48,392		三菱化工機	34	36	9,432		日新電機	14.6	11.4	15,223	
三井金属	161	163	97,148		月島機械	11.8	10.8	15,249		大崎電機	12	12	10,032	
東邦亜鉛	43	37	18,130		帝国電機製作所	8	6.6	7,840		オムロン	65.7	59.4	348,678	
三菱マテリアル	378	36.4	144,508		新東工業	14.6	14.2	17,522		日東工業	9.6	7.6	15,329	
住友鉱山	167	152	297,312		渋谷工業	5.5	5.3	19,106		I D E C	9.3	9.6	22,473	
DOWAホールディングス	80	64	52,672		アイチコーポレーション	10	9.7	7,430		ジーエス・ユアサコーポ	114	106	61,692	
古河金金	103	92	17,940		小森コーポレーション	15.2	14.3	19,962		サクサホールディングス	—	28	5,964	
大阪チタニウム	6.8	7.4	11,840		鶴見製作所	5.1	4.9	10,113		メルコホールディングス	4.2	3.3	12,160	
東邦チタニウム	11.9	11.5	9,338		住友精製	21	19	6,669		日本電気	797	762	227,838	
UACJ	88	83	26,809		荏原製作所	135	26.1	95,395		富士通	560	541	457,740	
古河電工	194	19.9	125,171		西島製作所	7.7	6.4	7,616		沖電気	260	23.9	35,945	
住友電工	241.1	219.6	389,790		北越工業	14.3	10	10,850		電気興業	19	17	9,860	
フジクラ	84	78	72,150		ダイキン工業	85	76.3	863,334		サンケン電気	36	34	19,788	
昭和電線HLDGS	98	96	10,080		オルガン	14	16	9,440		アイホン	4.1	4.2	7,614	
タツタ電線	16.7	15	12,855		トーヨーカナツ	42	31	12,090		ルネサスエレクトロニクス	33	31	39,990	
リョービ	39	34	20,468		栗田工業	35.2	31.3	101,725		セイコーエプソン	86.2	83.7	236,285	
アーレステイ	9.4	8	7,312		椿本チエイン	34	31	27,776		ワコム	48.4	44.7	23,288	
アサヒHD	9.4	8.7	20,166		アネスト岩田	11.6	10.8	11,383		アルバック	10.9	9.7	64,699	
金属製品 (0.7%)					ダイフク	31.2	28.3	157,914		アクセル	4.9	4.9	3,753	
稲葉製作所	4.5	4.3	6,032		加藤製作所	21	3.6	11,952		EIZO	6.1	5.8	26,129	
宮地エンジニアリング	56	24	7,488		油研工業	54	36	9,180		ジャパンディスプレイ	110.1	108.2	21,423	
トーカロ	5.3	4.3	18,619		タダノ	28	29.8	39,783		日本信号	16.6	15.4	18,972	
SUMCO	48.8	52	88,816		フジテック	17	16.2	25,498		京三製作所	19	20	11,200	
川田テクノロジー	1.5	1.4	8,470		CKD	17.3	17.4	37,879		能美防災	7.1	6.5	11,030	
東洋製罐グループHD	41.1	39.3	75,023		キトー	9.3	8.1	10,440		ホーチキ	5.6	5.1	10,801	
ホッカンホールディングス	20	18	7,596		平和	18	17.1	36,884		エレコム	5.9	5.2	11,674	
横河ブリッジHLDGS	12.4	10.5	22,123		理想科学工業	6.7	5.5	11,313		日本無線	21	3.5	5,848	
駒井ハルテック	—	2.5	5,847		SANKYO	15.3	14.3	50,121		パナソニック	666.3	642.1	1,060,428	
三和ホールディングス	61.4	57.5	73,427		日本金銭機械	6.7	6.5	7,462		アンリツ	34.6	42.1	37,426	
文化シャッター	18.2	15.9	14,310		マースエンジニアリング	3.9	3.5	8,088		富士通ゼネラル	18	19.5	44,362	
三協立山	8.3	8.4	13,003		福島工業	4.2	3.7	15,614		日立国際電気	14	14.7	43,717	
アルインコ	6.8	6.4	8,230		ダイコク電機	3.4	3.3	5,517		ソニー	412.5	395.2	1,696,988	
LIXILグループ	83.2	82	250,510		竹内製作所	12.2	10.7	24,545		TDK	34.9	31.1	233,872	
ノーリツ	11.8	11.9	23,383		アマノ	18	17.1	45,263		帝国通信工業	46	30	6,900	
長府製作所	5.9	5.7	15,390		JUKI	10.4	8.9	14,070		ミツミ電機	24.9	—	—	
リンナイ	11.2	10	97,000		サンデンホールディングス	37	41	17,630		タムラ製作所	27	25	15,800	
岡部	13.7	11.6	11,901		蛇の目ミシン	12	7.5	5,737		アルプス電気	50.7	51.8	157,213	
ジーテクト	7.3	6.1	13,548		マックス	10	10	15,400		パイオニア	97.4	83.3	17,159	
東プレ	12.2	10.9	36,460		グローリー	19.7	17.1	68,058		日本電波工業	8.1	7.4	6,275	
高周波熱錬	12.8	11.2	12,544		新晃工業	5.3	6.2	10,967		日本トリム	1.9	1.4	6,531	
東京製鋼	49	4.8	7,987		大和冷機工業	10.8	10.2	12,586		ローランドディー・ジー	3.6	3.5	9,709	
パイオラックス	3.3	9.5	27,502		セガサミーホールディングス	60.9	55.3	83,337		フオスター電機	7.7	6.9	16,070	
日本発条	53.3	52.9	62,686		日本ピストンリング	7.5	4	9,464		クラリオン	34	31	13,578	
三益半導体	5.5	5.8	10,393		リケン	31	2.8	15,652		SMK	22	17	8,330	
機械 (5.4%)					T P R	7.5	6.4	22,976		ヨコオ	8.1	6.3	9,128	
日本製鋼所	102	19	49,685		ツバキ・ナカシマ	—	6.3	16,184		ホシデン	19.6	17.2	31,390	
三浦工業	27.2	23.9	62,665		ホシザキ	12.9	17.7	179,478		ヒロセ電機	9.2	9	144,270	
タクマ	23	19.7	26,831		大豊工業	6	5.2	8,803		日本航空電子	17	16	29,168	
ツガミ	20	18	18,324		日本精工	118.7	115.6	169,007		T O A	7.9	7	8,470	
オークマ	40	38	42,788		NTN	145	129	60,630		日立マクセル	9.8	8.5	21,573	
東芝機械	34	31	18,724		ジェイテクト	59.8	57.6	88,185		古野電気	10.1	8.8	6,107	
アマダホールディングス	85.8	77.2	95,882		不二越	54	53	33,284		ユニデンホールディングス	94	30	8,610	
アイダエンジニア	16.9	16.1	20,930		日本トムソン	22	20.1	12,743		アルパイン	14.4	14.1	29,328	
滝澤鉄工所	81	56	11,256		T H K	37.9	39.6	153,450		スミダコーポレーション	—	6.4	13,497	
富士機械製造	17.9	18.5	38,535		ユーシン精機	3.1	3.3	10,048		アイコム	4.2	3.5	9,439	
牧野フライス	31	30	28,950		イーグル工業	7.7	6.3	12,996		リオン	—	3.4	7,803	
オーエスジー	27.4	24.4	60,878		日本ピラー工業	7.5	7	11,389		船井電機	6.7	6.3	5,392	
旭ダイヤモンド	17.2	16.7	18,904		キッツ	29.2	28.8	25,574		横河電機	58.7	60.3	113,786	
DMG森精機	33.9	30.9	59,946		日立工機	7.2	—	—		新電元工業	23	25	17,350	
ソディック	15.3	16.6	23,389		マキタ	37.5	73.1	338,087		アズビル	18.2	16.6	80,842	
ディスコ	7.7	7	162,400		日立造船	46.7	42.6	24,537		日本光電工業	24.2	23	57,500	
日東工器	4.1	3.4	9,302		三菱重工業	1,032	932	407,004		共和電業	13.7	16.8	7,123	
O K K	42	59	7,788		I H I	446	432	166,320		堀場製作所	10.7	10.8	69,876	
島精機製作所	8.8	8	43,200		スター精密	—	10.1	19,200		アドバンテクト	40.3	38.6	81,716	
NCホールディングス	3.2	—	—		電気機器 (13.6%)				エスペック	7.1	5.6	12,454		
フリュー	—	4.5	4,882		日清紡ホールディングス	30.2	28.1	37,288		パナソニックデバイス	8.3	—	—	
日阪製作所	9.4	9.3	9,151		イビデン	36.1	39.1	70,966		キーエンス	13.3	25.4	1,524,000	
やまびこ	12.1	11.3	16,249		コニカミノルタ	144.5	129.2	120,156		日置電機	3.8	3.2	7,568	
ペガサスミシン製造	—	9.6	7,238		ブラザー工業	73.9	68.8	181,219		シスメックス	45.6	43.5	310,155	
ナブテスコ	31.2	30	129,000		ミネベアミツミ	94	103.3	196,166		日本マイクロニクス	—	10.7	11,074	
三井海洋開発	7.4	6.1	15,408		日立	1,482	1,342	1,064,340		メガチップス	7.7	5.6	21,084	
レオン自動車	—	6.9	9,784		東芝	1,240	—	—		OBARA GROUP	3.9	3.5	21,245	
S M C	18.2	17.6	705,760		三菱電機	619	595	1,044,225		コーセル	9.4	8.6	12,736	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
イリソ電子工業	—	4.8	—	29,088	ヨロズ	5.8	5.2	—	11,897	西部瓦斯	—	67	—	58
オプテックスグループ	4.7	4.8	—	20,568	エフ・シー・シー	9.8	9.2	—	23,036	静岡ガス	18.7	13.9	—	12,468
千代田インテグレ	3.6	2.9	—	7,342	シマノ	23.6	22.6	—	336,062	メタウォーター	3.9	3.3	—	10,131
レーザーテック	7.9	13.4	—	30,324	テイ・エス テック	13.4	12.5	—	45,187	陸運業 (4.0%)				
スタンレー電気	41.2	39.7	—	153,639	ジャムコ	4.2	3.5	—	8,823	SBSホールディングス	7.7	6.8	—	5,344
岩崎電気	64	33	—	6,534	精密機器 (1.6%)					東武鉄道	309	294	—	183,750
ウシオ電機	35.2	32.7	—	49,213	デルモ	89.9	85.3	—	385,982	相鉄ホールディングス	98	85	—	47,005
日本セラミック	3.9	6.2	—	19,127	日機装	22.4	20	—	20,560	東京急行	339	149.6	—	240,108
遠藤照明	—	4.2	—	5,812	島津製作所	74	71.9	—	162,134	京浜急行	155	155	—	179,800
日本デジタル研究所	6	—	—	—	JMS	20	22	—	7,436	小田急電鉄	186	88.6	—	189,692
古河電池	—	8	—	9,016	ブイ・テクノロジー	1.7	1.2	—	23,568	京王電鉄	162	152	—	142,728
山一電機	11.6	6.3	—	12,461	東京計器	42	29	—	8,787	京成電鉄	87	41.5	—	128,857
図研	8.9	5.6	—	9,329	東京精密	11.5	10.7	—	42,586	富士急行	17	16	—	19,520
日本電子	27	21	—	11,424	マニ	7.3	7	—	18,781	新京成電鉄	25	14	—	5,852
カシオ	59.5	44.5	—	70,176	ニコン	107.5	96.1	—	181,629	東日本旅客鉄道	106.6	108.3	—	1,104,118
ファナック	59	56.7	—	1,290,208	トプコン	20.2	28.4	—	57,396	西日本旅客鉄道	55.9	53.9	—	424,570
日本シイエムケイ	—	13.5	—	14,418	オリンパス	87.5	89	—	343,985	東海旅客鉄道	52.1	46.4	—	901,784
エンプラス	3.2	2.6	—	12,272	理研計器	5.9	5.9	—	12,620	西武ホールディングス	61.4	77.4	—	142,725
ローム	28.2	27.2	—	255,680	タムロン	5.4	4.2	—	8,950	鴻池運輸	9.1	8.7	—	14,207
浜松ホトニクス	44.8	39.8	—	142,882	ＨＯＹＡ	132.3	115	—	720,015	西日本鉄道	76	61	—	33,184
三井ハイテック	11.1	8.6	—	22,050	ノーリツ鋼機	10.5	6.7	—	9,989	ハマキョウレックス	5.5	4.1	—	12,246
新光電気工業	22.8	22.4	—	16,979	エー・アンド・デイ	—	13.1	—	7,047	スカイ引越センター	3	2.9	—	16,907
京セラ	95	91.3	—	637,547	シチズン時計	70.2	58	—	45,182	近鉄グループHLDGS	577	547	—	233,022
太陽誘電	29.2	27	—	47,034	リズム時計	37	39	—	9,126	阪急阪神HLDGS	77.4	70	—	297,150
村田製作所	61.8	58.7	—	1,009,933	大研医器	6.7	7.1	—	5,530	南海電鉄	130	116	—	65,192
ユージン	15.2	13.5	—	10,854	メニコン	4.1	3.9	—	17,160	京阪ホールディングス	128	123	—	82,902
双葉電子工業	10.3	8.4	—	17,833	松風	4.4	4.4	—	5,759	神戸電鉄	27	22	—	9,086
北陸電気工業	86	45	—	7,110	セイコーHD	38	38	—	18,962	名古屋鉄道	209	199	—	98,903
ニチコン	19.3	18.6	—	24,700	ニプロ	43.1	38.6	—	56,742	山陽電鉄	27	22	—	12,848
日本ケミコン	55	51	—	20,094	その他製品 (2.2%)					日本通運	221	205	—	151,905
KOA	9.1	8.9	—	18,574	パラマウントベッドHD	6.3	5.2	—	25,662	ヤマトホールディングス	106	100.2	—	232,063
市光工業	—	15	—	10,830	ニホンフラッシュ	—	4.5	—	7,272	山丸	76	74	—	66,970
小糸製作所	34.7	33.6	—	244,608	前田工業	8	7.7	—	14,067	丸全昭和運輸	24	21	—	10,815
ミツバ	10.3	10.6	—	17,808	永大産業	14	15	—	8,160	センコーグループHLDGS	27	26.5	—	21,306
スター精密	11.9	—	—	—	アートネイチャー	7.1	8	—	5,704	トナミホールディングス	16	15	—	8,025
SCREENホールディングス	60	11.5	—	87,400	ダンロップスポーツ	—	4.1	—	6,330	ニッコンホールディングス	17.6	17.8	—	47,526
キャノン電子	6	6.1	—	13,914	バンダイナムコHLDGS	59.6	61.9	—	225,625	福山通運	34	30	—	20,460
キャノン	311	299.5	—	1,149,181	共立印刷	38.4	27.1	—	9,322	セイノーホールディングス	40	38.8	—	58,432
リコー	187.3	166.8	—	183,480	S H O E I	—	3.2	—	10,656	神奈川中央交通	13	8	—	5,864
東京エレクトロ	47.9	37.5	—	646,125	フランスベッドHLDGS	9.4	4.3	—	4,510	日立物流	12.6	11.3	—	28,272
輸送用機器 (8.9%)					パイロットコーポレーション	10.3	9.7	—	50,343	丸和運輸機関	—	1.7	—	7,837
トヨタ紡織	20.5	19.2	—	44,217	萩原工業	—	2.6	—	9,308	九州旅客鉄道	—	56.1	—	183,727
ユニプレス	12.4	10.5	—	30,492	トッパン・フォームズ	11	8.9	—	10,510	海運業 (0.2%)				
豊田自動織機	51.9	51	—	320,280	フジールインターナショナル	7.1	12.8	—	44,672	日本郵船	507	469	—	108,808
モリタホールディングス	11	10.4	—	18,189	タカラトミー	20.1	22.5	—	32,557	商船三井	283	292	—	102,492
三桜工業	10.4	10.3	—	9,321	大建工業	28	4.6	—	12,622	川崎汽船	257	208	—	60,944
デンソー	143.1	137.6	—	757,075	凸版印刷	160	153	—	170,442	NS ユナイテッド海運	34	29	—	7,105
東海理化電機	16.7	13.7	—	29,496	大日本印刷	168	154	—	204,050	飯野海運	34.9	29	—	14,703
三井造船	231	197	—	27,974	図書印刷	15	—	—	—	空運業 (0.6%)				
川崎重工業	449	429	—	157,443	共同印刷	26	19	—	7,068	日本航空	110.4	97.9	—	370,747
名村造船所	18.4	18.4	—	11,573	日本写真印刷	10.3	10.1	—	29,421	ANAホールディングス	1,072	1,039	—	436,068
日本車輛	30	26	—	7,774	光村印刷	—	29	—	7,134	倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
近畿車輛	13	—	—	—	宝印刷	7.8	5.7	—	9,399	トランコム	2	1.8	—	10,926
日産自動車	793.9	658.9	—	759,711	アシックス	54.2	55.1	—	92,512	日新	29	28	—	16,716
いすゞ自動車	167.3	161.7	—	241,013	ツツミ	3.5	2	—	3,792	三菱倉庫	39	34	—	47,464
トヨタ自動車	742.2	679.3	—	4,571,009	小松ウオール工業	2.6	—	—	—	三井倉庫 HOLD	39	38	—	12,920
日野自動車	82.1	80.6	—	109,616	ヤマハ	42.8	37.8	—	147,798	住友倉庫	35	35	—	26,400
三菱自動車工業	233.8	206	—	178,190	河合楽器	3	3.4	—	7,599	渋沢倉庫	22	30	—	11,910
エフテック	4.9	5	—	9,025	クリナップ	9.1	7.1	—	6,404	東陽倉庫	25	26.2	—	8,069
武蔵精密工業	6.5	6.9	—	23,356	ビジョン	33.2	34	—	137,190	日本トランスシティ	18	20	—	9,360
日産車体	24.9	23.9	—	30,137	キングジム	8.5	8.2	—	8,306	安田倉庫	7.1	—	—	—
新明和工業	26	22.7	—	23,358	リンテック	12.5	11.9	—	36,652	東洋埠頭	79	50	—	9,700
極東開発工業	12.3	11.8	—	21,299	イトーキ	13.8	13.5	—	11,515	上組	64	66	—	84,216
日信工業	13.1	12	—	24,048	任天堂	36.1	34.5	—	1,412,775	キューソー流通システム	2.9	2.1	—	6,373
トピー工業	52	4.7	—	17,578	三菱鉛筆	4.6	9.6	—	27,254	郵船ロジスティクス	6.7	4.7	—	4,728
テトラド	35	25	—	11,500	タカラスタンダード	23	10.6	—	20,892	近鉄エクスプレス	11.1	10.2	—	18,023
曙ブレーキ	43.2	29.2	—	10,453	コクヨ	30.2	26.5	—	48,813	東海運	—	11.5	—	4,726
タチエス	9.9	9.8	—	19,903	ナカバヤシ	18	21	—	7,035	内外トランスライン	—	6.2	—	9,591
NOK	27.9	26.7	—	69,233	グローブライド	3.7	3.6	—	6,994	情報・通信業 (7.7%)				
フタバ産業	21.8	18.9	—	24,059	岡村製作所	20.7	19.2	—	23,654	NEC ネットウェア	7	5.8	—	15,602
K Y B	66	64	—	40,640	美津濃	32	30	—	19,530	システナ	7.4	5.3	—	15,004
大同メタル工業	9.2	7.4	—	7,422	アデランス	13	—	—	—	デジタルアーツ	4.2	2.9	—	13,441
プレス工業	32.9	30.1	—	18,902	電気・ガス業 (1.7%)					新日鉄住金SOI	10.2	9.2	—	23,018
カルソニックカンセイ	45	—	—	—	東京電力HD	494.9	472.5	—	216,405	ソフトクリエイティブHD	—	5.3	—	7,923
太平洋工業	14	13.4	—	19,322	中部電力	179.1	184.3	—	265,115	T I S	19.4	18.5	—	58,552
ケーヒン	13.2	11.6	—	21,274	関西電力	241.3	229.4	—	353,390	電算システム	3.4	3.3	—	6,402
河西工業	8.3	8.5	—	14,382	中国電力	78.3	74.4	—	92,330	グリ	36.3	38.1	—	29,222
アイシン精機	59	51.4	—	288,354	北陸電力	55.4	51.8	—	52,732	コーエーテックMHD	14	13.1	—	29,697
富士機工	10.3	—	—	—	東北電力	145.3	139.9	—	209,010	三菱総合研究所	2.9	2.6	—	8,450
マツダ	182.9	175.6	—	291,320	四国電力	51.6	50.5	—	71,508	ファインテック	—	5.6	—	4,692
今仙電機製作所	7.4	8.1	—	10,432	九州電力	130.2	123.1	—	151,905	K L a b	11	11.1	—	19,425
本田技研	523.6	502	—	1,653,588	北海道電力	55.2	51.5	—	42,951	ポルトックウィン・ピットクル	9.1	5.8	—	8,943
スズキ	107.9	111.3	—	682,046	沖縄電力	9.6	9.8	—	24,049	ネクソン	56.1	61.3	—	180,405
SUBARU	184.8	173.8	—	691,724	電源開発	48.8	44.2	—	129,417	アイスタイル	11	14.5	—	9,497
ヤマハ発動機	81.2	79.2	—	259,380	イーレックス	—	8.2	—	8,601	エイチーム	4.4	5	—	15,325
ショーワ	15.9	15.9	—	20,367	東京瓦斯	649	602	—	345,849	テクノスジャパン	—	6.1	—	6,453
T B K	25.4	20	—	9,980	大阪瓦斯	594	544	—	233,104	コロブラ	16.4	17.9	—	22,786
エクセディ	7.2	7.6	—	25,384	東邦瓦斯	145	137	—	95,352	ブロードリーフ	7.8	15.3	—	13,372
豊田合成	19	17.1	—	46,135	北海道瓦斯	34	26	—	7,254	ハーツユニテッドグループ	—	4.2	—	6,195
愛三工業	11.2	10	—	10,160	広島ガス	23.3	20.6	—	7,292	ティーガイア	6.2	5.7	—	11,998

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円
豆蔵ホールディングス	—	7.2	8,085	マクニカ・富士エレクトロ	10.9	10.3	20,898	スズケン	25.8	25	98,875									
テックマトリックス	—	4.6	7,134	バイタルK S K HD	11.1	9.5	8,939	ジェコス	4.9	5.5	6,726									
ガンホー・オンライン・エンター	133.3	150.5	45,451	UKCホールディングス	4.3	4.6	8,891	小売業 (4.6%)												
GMOペイメントゲートウェイ	5.2	4.2	30,114	TOKAIホールディングス	29.3	25.1	21,259	ローソン	22	17.2	125,044									
インターネットアジアティブ	9.9	9.1	19,383	三洋貿易	5.3	4.7	12,328	サンエー	4	4.2	21,000									
さくらインターネット	—	6	5,214	ウイン・パートナーズ	—	6.3	9,317	カワチ薬品	4.9	4.6	12,420									
SRAホールディングス	4.3	3.5	10,251	シッフヘルズケアHD	11.8	10.2	36,567	エービーシー・マート	7.6	9.9	57,717									
朝日ネット	15	17.6	9,363	コメダホールディングス	—	10.4	19,541	ハードオフコーポレーション	6.9	5.3	6,031									
コムチューア	—	1.7	9,860	小野建	6.5	5.5	10,466	アスクル	7.2	6.1	20,740									
gumi	8.1	7	7,637	佐島電機	14.2	8.5	8,279	ゲオホールディングス	11.2	8.8	13,569									
LINE	9.5	15.8	62,410	伯東	—	5.3	8,851	アダストリア	10.9	8.8	21,260									
野村総合研究所	40.5	41.5	174,922	コンドーテック	—	7.7	8,631	くらコーポレーション	3.6	3.3	16,566									
インテージホールディングス	4.3	3.9	11,122	ナガイレーベン	9.3	7.4	22,126	キャンドウ	5.6	4.5	7,875									
フジ・メディア・HD	58.7	56.4	88,604	三菱食品	6.4	5.5	17,737	パルグループHLDGS	3.7	3.1	11,036									
オービック	19.9	19.2	133,248	松田産業	5.9	4.6	7,507	エディオ	24.8	21	22,218									
ジャストシステム	12.9	10.1	24,038	第一興商	10.2	8.9	47,793	サーラコーポレーション	—	11.3	10,045									
TDCソフトウェアエンジニア	—	5.4	6,199	メディアパルHD	56.5	55.1	107,059	ワッツ	—	5.2	6,536									
ヤフー	424.3	405.4	205,132	萩原電気	—	3.5	9,747	ハローズ	—	2.1	5,063									
トレンドマイクロ	28.1	27	151,470	アズワン	4.8	4.2	26,838	あみやき亭	1.5	1.8	8,559									
日本オラクル	9.6	8.9	72,980	シモジマ	6.3	4.9	5,507	ひらまつ	12.6	14.7	9,025									
フューチャー	10.2	10.3	9,723	ドウシシャ	7.4	6.8	16,388	ゲンキー	1.7	2.5	11,462									
CAC HOLDINGS	9.7	6	6,288	小津産業	—	4	8,480	大黒天物産	—	1.6	8,416									
ソフトバンク・テクノ	—	4	7,204	黒田電気	11.2	7.3	14,519	ハニースホールディングス	6.7	6.9	8,673									
オービックビジネスC	3.2	2.9	16,327	丸文	11.8	5.8	4,959	アルペン	5.5	3.8	8,367									
伊藤忠テクノソリューション	13.3	12.9	52,374	ハビネット	6.5	5.8	9,854	クオール	6.8	6.9	13,268									
アイティフォー	24	14.2	8,789	日本ライフライン	—	6.7	38,056	ジーンズ	4.1	4	26,680									
大塚商会	15.8	16.8	118,944	エクセル	4.2	4.2	8,001	ビックカメラ	32.6	31.7	41,241									
サイボウズ	27.5	14.2	7,284	マルカキカイ	—	4	7,308	DCMホールディングス	28	32.8	33,587									
ソフトブレイン	—	8	3,304	I D O M	16.6	17	11,390	MonotaRO	21	20.1	70,249									
電通国際情報S	4.5	4.2	10,571	進和	4.9	5.4	12,047	アークランドサービスHD	2.6	5.6	12,560									
デジタルガレージ	—	11.3	25,029	シークス	4	3.6	17,010	J. フロントリテイリング	72.4	69.8	104,490									
ウェザーニューズ	2.5	2.6	9,178	伊藤忠	452.9	405	742,365	ドトール・日elisHD	10.2	9.4	22,644									
C I J	14.1	16.4	10,381	丸紅	559.5	546.1	405,697	マツモトキヨシHLDGS	11.9	10.5	82,530									
WOWOW	3.5	3.4	12,648	高島	66	32	7,520	ブロンコビル	3.3	3.5	9,618									
ネットワンシステムズ	26.6	25.8	29,953	長瀬産業	26	30	54,690	スタートトゥデイ	18	49.4	178,087									
アルゴグラフィックス	—	3.8	12,939	蝶理	4.7	4.8	10,075	物語コーポレーション	1.9	2	14,360									
マーベラス	11.6	10.8	10,465	豊田通商	62.1	61.9	226,554	ココカラファイン	6.1	5.8	36,772									
エイベックス・グループHD	11.2	10.5	15,246	三共生興	13.2	—	—	三越伊勢丹HD	113.5	110.4	126,960									
日本ユニシス	16.8	15.7	26,909	兼松	129	121	33,275	ウエルシアHD	5.1	15.3	69,079									
兼松エレクトロニクス	5.2	3.9	12,811	三井物産	520.7	499	841,563	クリエイティブSDH	8.9	8.1	24,340									
東京放送HD	33.7	36.6	76,567	日本紙パルプ	28	27	12,933	丸善CHIHD	—	16.7	5,878									
日本テレビHLDGS	51.9	49.5	94,693	日立ハイテクノロジーズ	19.5	19.3	78,358	チムニー	2	1.3	3,786									
テレビ朝日HD	16	14.9	31,960	カメイ	8.5	7.6	13,087	ジョイフル本田	9.3	9.2	26,946									
スカパーJSATHD	46.7	33.2	16,799	東都水産	28	—	—	鳥貴族	—	3	9,810									
テレビ東京HD	6.2	5.3	12,587	OUGホールディングス	—	27	7,803	すかいらーく	17.7	34	55,352									
ワイヤレスゲート	—	4.7	6,387	スターゼン	2.5	2.5	13,275	綿半ホールディングス	—	3.6	8,870									
コネクシオ	6.7	5.5	10,813	山善	23.4	20.6	24,369	ユナイテッド・スーパーマケ	19.4	18.9	20,393									
日本通信	46	56.9	7,852	住友商事	355.2	344.9	554,771	ブックオフコーポレーション	—	11.7	9,418									
日本電信電話	444	442.9	2,274,291	内田洋行	19	3.2	11,056	あさひ	5.3	4.9	6,252									
KDDI	569.3	537.9	1,603,479	三菱商事	431.9	414.6	1,086,459	日本調剤	1.9	2.1	7,612									
光通信	6.8	6.7	91,790	第一実業	18	17	10,455	コスモス薬品	2.9	2.8	73,332									
NTTドコモ	429.5	405.7	1,048,125	キャノンマーケティングJPN	16.3	16	41,600	一六堂	—	17.1	7,079									
エムティーアイ	10.6	10.3	7,343	西華産業	29	22	13,046	セブン&アイHLDGS	241.4	231	1,018,017									
GMOインターネット	22.2	21.9	32,850	菱洋エレクトロ	7.7	5.2	10,259	薬王堂	—	3.6	10,699									
カドカワ	18.3	16.3	21,907	ユアサ商事	6.1	5.6	21,476	クリエイト・レストランツ・ホール	16.8	17	20,281									
学研ホールディングス	28	3.2	10,416	神鋼商事	54	2.6	10,153	ツルハホールディングス	13.5	11.2	151,872									
ゼンリン	8.4	8	27,200	阪和興業	59	56	42,952	サンマルクホールディングス	4.8	3.6	11,916									
松竹	38	3.6	58,140	カナデン	10.1	8.9	10,475	トリドールホールディングス	7.3	7.2	25,452									
東宝	40.9	36.1	141,873	菱電商事	13	10	8,050	クスリのアオキ	5.5	—	—									
東映	22	20	25,440	岩谷産業	67	59	39,353	ダイユー・リックHLDGS	—	9.4	8,074									
NTTデータ	36.4	170.3	204,360	すてきなイスグループ	36	45	6,930	クスリのアオキHLDGS	—	4.6	31,326									
DTI	7.2	6.3	19,561	三菱石油	15	15.1	18,935	メディカルシステムネットワーク	14.9	—	—									
スクウェア・エニックス・HD	24.4	21.4	83,995	稲畑産業	15.2	12.7	18,669	総合メディカル	3.1	3	15,960									
シーイーシー	5.9	4.4	11,215	ワキタ	12.8	12.8	16,960	ノジマ	—	9.2	18,924									
カプコン	14.9	12.9	35,126	東邦ホールディングス	18.7	16.8	35,095	カップ・クリエイト	9.4	7.5	9,802									
ジャステック	10.7	5.8	7,731	サンゲツ	20	17.7	35,612	ライトオン	5.7	5.7	5,329									
SCSK	14.2	15.5	71,920	ミツウロコグループ	10.9	9.5	8,208	良品計画	6.7	7.4	250,860									
アイネス	10.1	8.8	9,002	シナノンホールディングス	16	2.7	6,145	アドヴァン	—	6.9	6,589									
T K C	5.8	5.2	17,160	伊藤忠エネクス	15.2	10.2	11,801	アルビス	2.3	2.2	9,339									
富士ソフト	9	7.5	24,525	サンリオ	17.5	16.4	35,506	コナカ	11	12	6,708									
NSD	13.1	11.7	23,844	サンワテクノス	5.9	—	—	コーナン商事	8.9	7.6	15,716									
コナミホールディングス	26.1	25.3	142,439	リョーサン	9.1	7.3	34,419	ワタミ	9	7.2	11,217									
福井コンピュータHLDGS	—	2.1	6,075	新光商事	7.7	6.9	13,061	ドンキホーテホールディング	37.2	36	154,440									
JBCCホールディングス	10	11.5	12,305	トーホー	3.6	3.2	8,544	西松屋チェーン	12	9.7	12,095									
ミロク情報サービス	6.6	6.4	17,043	三信電気	9.6	6.9	11,447	ゼンショーホールディングス	29.4	29.2	60,414									
ソフトバンクグループ	327	248.8	2,215,315	東陽テクニカ	10.4	7.4	7,696	幸楽苑ホールディングス	5.6	6.9	12,075									
卸売業 (4.5%)				モスフード サービス	7.7	7.2	25,668	サイゼリヤ	9.8	8.6	26,746									
エレマテック	—	2.3	4,793	加賀電子	6	5.4	17,226	V Tホールディングス	21.7	19.5	12,460									
JALUX	3	—	—	PAL TAC	9.4	9.3	40,176	ポプラ	—	10.5	6,174									
あたら	3	3	14,325	ヤマタネ	77	5.8	10,788	ユナイテッドアローズ	8.3	7.6	31,160									
フィールズ	4.7	4.4	4,972	丸紅建材リース	—	34	7,582	ハイデイ日高	5.6	6.5	22,457									
双日	366.7	309.3	94,955	日鉄住金物産	47	4.7	29,140	京都きもの友禅	8.5	11.3	10,576									
アルフレッサホールディングス	71.4	64.3	131,815	トラスコ中山	6.9	11.7	31,812	コロワイド	19.3	17.6	37,065									
横浜冷凍	15.7	12.8	13,964	オートパックスセブン	21.5	18.9	35,664	香番屋	5.4	3.9	18,778									
山下医科器械	—	4	6,828	加藤産業	8.2	8	26,480	スキホールディングス	10.2	12.1	71,753									
アルコニクス	5.3	8.6	15,729	イノテック	19.1	9.9	9,355	スクロール	19.8	12.7	4,965									
神戸物産	4.3	3.9	20,007	イェローハット	5.8	5.2	16,224	ヨンドシーホールディングス	4.8	5.7	18,468									
あいホールディングス	10.8	8.2	23,042	日伝	2.9	2.7	12,312	ユニ・ファミリーマートHD	25.6006	24.4	139,812									
ディー・アイエックス	—	5.4	7,819	因幡電機産業	6.8	6.5	28,795	木曾路	7.9	6.7	18,773									
ダイワボウHD	58	52	23,140	ミスミグループ本社	64	64.2	194,526	サトレストランシステムズ	10.4	10.1	9,554									

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
千趣会	14.2	13.6	9,180	福井銀行	51	51	14,790	アコム	122.6	116.7	50,997									
ケヨー	13.2	14.5	11,353	北國銀行	59	55	25,850	ジャックス	33	32	17,440									
上新電機	15	14	25,620	清水銀行	2.7	3	10,095	オリコ	248.4	118	21,594									
日本瓦斯	9	10.5	37,800	滋賀銀行	49	43	25,714	日立キャピタル	13.9	12.9	34,043									
ロイヤルホールディングス	10	9.6	27,014	南都銀行	52	6.5	20,117	オリックス	408.8	390.2	707,042									
いなげや	7.6	6.9	13,586	百五銀行	50	44	20,900	三菱UFJリース	141.1	140	80,920									
島忠	14.6	13.5	37,543	京都銀行	107	99	107,613	日本取引所グループ	166.7	173.4	334,141									
チヨダ	6.8	6.3	17,696	紀陽銀行	21.7	19.5	34,515	イー・ギャラリーンティ	3.1	2.7	8,451									
ライフコーポレーション	4.1	4.2	11,898	三重銀行	28	3.8	9,834	NECキャピタルソリューション	3.4	3.5	7,336									
リンガーハット	5.8	6.7	17,219	ほくほくフィナンシャルG	370	35.1	59,880	不動産業 (2.3%)												
AOKIホールディングス	13.4	9.4	13,460	広島銀行	165	160	70,240	いちご	60.9	53.6	20,153									
オークワ	10	9	10,701	山陰合同銀行	34	30.6	28,488	日本駐車場開発	78.1	80.7	13,315									
コメリ	8.7	8.1	25,960	中国銀行	37.8	37.5	55,650	ビューリック	120	115.6	121,148									
青山商事	10.9	11.2	44,520	鳥取銀行	34	6	10,266	野村不動産HLDGS	37	39.3	87,914									
しまむら	6.7	6.4	86,720	伊予銀行	55.8	78.1	65,135	三重交通グループHD	14.7	9.9	4,415									
高島屋	84	91	94,913	百十四銀行	60	52	19,448	サムティ	—	6.2	10,434									
松屋	12.5	13.6	14,579	四国銀行	46	45	14,895	日本商業開発	—	4.7	8,272									
エイチ・ツー・オーテイリング	29.2	28.1	55,272	阿波銀行	44	45	31,860	プレサンスコーポレーション	2.3	9.7	14,928									
近鉄百貨店	27	1.5	5,580	大分銀行	33	29	13,282	ユニゾホールディングス	4.1	5.5	14,294									
パルコ	6.6	—	—	宮崎銀行	39	38	15,200	日本管理センター	5.5	4.6	6,900									
丸井グループ	70.6	58.8	95,667	佐賀銀行	38	32	8,672	フージャースHD	—	10.9	12,524									
アクシアルリテイリング	4.8	4.4	19,888	十八銀行	37	39	10,491	オープンハウス	8.9	9.4	33,229									
イオン	238.5	226	370,301	沖縄銀行	5.5	5.2	23,738	東急不動産HD	139.3	129.3	84,950									
イズミ	11.2	10.3	61,697	琉球銀行	12.5	11.5	19,067	飯田GHHD	52.6	45.4	88,257									
東武ストア	1.7	—	—	セブン銀行	208.7	208.5	86,319	パーク24	29	30.9	83,955									
平和堂	11.7	10.6	26,765	みずほフィナンシャルG	8,180.9	7,486.6	1,465,876	バラカ	—	3.5	8,659									
フジ	6.8	5.9	16,927	高知銀行	107	85	10,710	三井不動産	305	293.2	685,208									
ヤオコー	6.6	6	32,580	山口フィナンシャルG	51.1	49	62,867	三菱地所	431	411.4	781,660									
ゼビオホールディングス	8	7	14,770	長野銀行	33	4.6	8,891	平和不動産	12.2	11.3	22,046									
ケースホールディングス	23.8	22.8	55,084	名古屋銀行	48	4	17,260	東京建物	62.8	59	81,597									
アインホールディングス	7.1	7.4	59,718	北洋銀行	82.5	84.8	29,086	ダイビル	15.7	14.4	16,488									
元気寿司	—	3.2	8,105	愛知銀行	2.1	2	13,100	京阪神戸ビルディング	11.8	12.7	9,017									
ヤマダ電機	170.9	186.5	111,527	第三銀行	39	3.5	6,212	住友不動産	138	133	457,387									
アークランドサカモト	10.7	9.7	15,529	中京銀行	27	2.2	5,192	大京	107	105	22,785									
ニトリホールディングス	25.3	24	414,000	大光銀行	28	30	7,200	テーオーシー	23	19.5	19,734									
吉野家ホールディングス	21.2	20.3	38,224	愛媛銀行	31	7.1	10,195	東京楽天地	19	1.4	7,756									
松屋フーズ	3.6	3.1	13,407	トマト銀行	85	6.2	9,442	レオパレス21	67.8	68.7	55,303									
サガミチェーン	9.5	8.5	12,010	みなと銀行	57	5.4	10,006	スターツコーポレーション	6.9	7.8	22,113									
関西スーパーマーケット	—	6.1	8,643	京業銀行	44	33	16,368	フジ住宅	12.2	10.5	8,557									
王将フードサービス	4.3	3.4	15,402	関西アーバン銀行	6.7	8.8	11,730	空港施設	12.1	7.6	4,484									
プレナス	6.7	6.5	15,892	栃木銀行	33	31.5	14,616	住友不動産販売	4.6	—	—									
ミニストップ	4.9	4.3	9,399	北日本銀行	2.8	3.1	9,362	ゴールドクレスト	4.9	5.4	13,732									
アークス	10.7	9.5	23,854	東和銀行	91	119	13,923	日神不動産	—	11.1	8,047									
パローホールディングス	12.4	11.2	26,936	福島銀行	102	108	9,612	タカラレーベン	27.1	25.2	13,255									
ベルク	3.1	2.8	15,960	大東銀行	61	45	7,650	サンヨーハウス名古屋	5.9	8.2	8,593									
大庄	—	4.3	7,297	トモニホールディングス	45.2	44	21,120	イオンモール	36	36	72,180									
ファーストリテイリング	9.7	9.3	305,040	フィデアホール	55.5	68.8	13,209	ファースト住建	—	4	6,784									
サンドラッグ	12.4	21.1	98,431	池田泉州HD	53	55.2	23,349	トーセイ	11.1	10.1	9,393									
サックスパーホールディング	7	6.9	9,163	証券・商品先物取引業 (1.0%)				エヌ・ティ・ティ都市開発	34.4	34	36,686									
ペルーナ	15.9	14.1	15,806	FPG	21.2	20.7	26,640	サンフロンティア不動産	8.5	7.1	8,094									
銀行業 (7.5%)				SBIホールディングス	68.8	62.5	100,000	エフ・ジェー・ネクスト	14.9	8.9	8,650									
じもとホールディングス	51.6	59.2	11,899	ジャフコ	10	9.5	52,155	グランディハウス	—	16	6,896									
足利ホールディングス	42.2	—	—	大和証券G本社	527	497	315,147	日本空港ビルデング	18.2	17.7	67,083									
めがきフィナンシャルG	—	266.8	109,654	野村ホールディングス	1,092.9	1,128.3	712,747	サービス業 (4.0%)												
東京TYフィナンシャルG	8.3	8.1	22,169	岡三証券グループ	42	44	27,544	日本工営	23	4.5	16,065									
九州フィナンシャルG	86	88.9	59,118	丸三証券	19.2	17.4	16,512	LIFULL	18.6	16.4	15,563									
ゆうちょ銀行	150.5	155.4	215,850	東洋証券	35	32	8,384	ジェイエイリゾートメント	—	4.9	8,187									
富士第一銀行	—	14.4	7,430	東海東京HD	64.7	57.5	36,857	日本M&Aセンター	9.7	17.2	93,052									
コンコディア・フィナンシャル	393.2	357.4	199,464	光世証券	68	39	6,474	アコーディア・ゴルフ	16.7	—	—									
西日本フィナンシャルHD	—	35.8	41,778	水戸証券	27.5	28.5	9,490	タケエイ	9.3	6.7	7,952									
新生銀行	519	523	91,525	いちよし証券	16.2	12.5	13,200	トラスト・テック	—	3.8	11,856									
あおぞら銀行	372	346	147,742	松井証券	23.5	27.2	23,392	パソナグループ	7.4	5.8	6,832									
三菱UFJフィナンシャルG	4,616.9	4,183	2,965,328	マネックスG	74.4	56.3	16,664	CD S	—	6.3	7,919									
りそなホールディングス	673.8	647.2	357,836	カブドットコム証券	55.8	37.9	12,507	リンクアンドモチベーション	—	13	9,035									
三井住友トラストHD	1,195	114.9	456,727	極東証券	9.9	8	12,136	GCA	8.6	7.5	7,762									
三井住友フィナンシャルG	461.2	442.4	1,897,011	岩井コスモホールディング	7.8	8	10,800	エス・エム・エス	8.6	8.8	32,252									
第四銀行	66	63	33,201	藍澤証券	14.1	14.8	11,440	パーソルホールディングス	43.6	46.1	111,008									
北越銀行	64	6.4	16,115	マネースクウェアHD	7.8	—	—	リニカル	—	4.1	6,227									
西日本シティ銀行	178	—	—	マネーパートナーズGP	—	10	4,710	クックパッド	14.5	17.9	13,872									
千葉銀行	218	213	162,093	保険業 (2.4%)				スタジアオアリス	3.6	2.9	7,693									
常陽銀行	198	—	—	かんぽ生命保険	24.4	20.1	47,978	シミックホールディングス	4.2	3.4	5,225									
群馬銀行	122	119.2	79,625	SOMPOホールディングス	126.9	115.2	521,740	総合警備保障	20.7	21.6	111,024									
武蔵野銀行	8.9	8	25,760	アニコムホールディングス	5.2	4.2	13,776	カカゴコム	44.5	42.3	57,654									
千葉興業銀行	19	17.6	9,979	MS&AD	170.3	154.2	562,830	ルネサンス	—	5.2	9,235									
筑波銀行	27.4	30.7	11,174	SONY FH	56.5	53.1	94,624	ディップ	7.6	8.4	21,420									
七十七銀行	87	84	44,520	第一生命HLDGS	365.3	333.2	632,913	オプトホールディング	—	6.7	8,361									
青森銀行	43	40	17,480	東京海上HD	231.8	221.9	1,004,097	新日本科学	—	8.6	4,609									
秋田銀行	40	32	11,136	T&Dホールディングス	207.8	200.8	314,754	ツクイ	17	16.3	12,290									
山形銀行	34	27	14,418	アドバンスクリエイト	—	3.5	6,807	エムスリー	54.1	51.6	166,410									
岩手銀行	4.1	2.8	12,250	その他金融業 (1.3%)				ツカダ・グローバルHOLD	6.8	—	—									
東邦銀行	49	43	17,673	全国保証	15.2	16	72,320	アウトソーシング	3.3	3.4	24,446									
東北銀行	89	73	10,950	クレディセゾン	43.5	41.2	84,666	ウェルネット	6.3	5.7	6,555									
みちのく銀行	30	41	7,790	芙蓉総合リース	6.7	6.5	47,450	ディー・エヌ・エー	28.1	27	65,799									
ふくおかフィナンシャルG	246	220	107,360	興銀リース	11.1	9.9	28,759	博報堂DY HLDGS	83.4	81.5	119,316									
静岡銀行	165	143	142,428	東京センチュリー	13.4	11	53,240	ぐるなび	7.5	8.7	14,276									
十六銀行	69	62	22,072	日本証券金融	24.1	23.8	14,280	エスアールゾータカミヤ	—	10.4	6,624									
スルガ銀行	56.6	56.4	131,637	アイフル	98.2	99.1	38,748	ジャパンベストレスクューS	—	16.5	7,078									
八十二銀行	97	103.5	69,862	ポケットカード	9.4	—	—	ファンコミュニケーションズ	15.9	16.3	19,820									
山梨中央銀行	34	33	15,147	リコーリース	4.9	4.8	19,968	ティア	—	10.1	8,766									
大垣共立銀行	75	84	25,452	イオンフィナンシャルサービス	37.4	35.5	83,744	インフォマート	13	29.3	22,912									

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
JPホールディングス	22.2	23.7	9,077	ペクトル	8.4	6.2	9,486	丹青社	13.6	12.1	17,024		
EPSホールディングス	7.7	8.3	17,488	アサンテ	—	4.2	7,854	メイテック	7.8	6.9	37,812		
プレステージ・インター	6.7	13.2	14,995	N・フィールド	—	4.5	7,402	アサツ ディ・ケイ	10.7	10	30,750		
アミューズ	4.2	3.9	10,857	リクルートホールディングス	124.1	385.7	948,822	応用地質	7.4	7	11,396		
ドリームインキュベータ	3.6	2.7	5,861	日本郵政	180.8	149.8	212,716	船井総研ホールディング	9.9	8.3	28,469		
クイック	—	5.1	9,373	ベルシステム24HLDGS	—	10.1	11,958	学究社	—	5.1	7,797		
ケネディクス	82.3	76.4	43,548	リログループ	2.4	30.4	78,067	ベネッセホールディングス	20	19.8	77,121		
電通	68.1	65.1	306,946	東祥	2.2	2.1	11,550	イオンデライト	6.2	6.5	26,520		
イオンファンタジー	3	2.1	7,948	エイチ・アイ・エス	10	8.7	30,711	ニチイ学館	12	11.6	13,873		
シーティーエス	—	9.8	7,379	共立メンテナンス	4.7	9.5	30,732	ダイセキ	12.1	10.2	29,121		
みらかホールディングス	15.3	14.6	74,460	イチネンホールディングス	11.7	7.1	10,607						
アルプス技研	3.8	3.1	11,315	建設技術研究所	5.7	7.2	7,430	合計	株数	金額	96,137,1006		
オリエンタルランド	66.3	63.3	538,113	東京テアトル	98	60	9,180	銘柄数<比率>	1,397銘柄	1,488銘柄	<99.2%>		
ダスキン	17.3	14.4	44,640	タナベ経営	—	4.3	6,101						
明光ネットワークジャパン	8.9	7.9	11,826	ナガワ	—	1.1	4,532						
ファルコホールディングス	4.1	6.6	10,824	よみうりランド	18	15	7,230						
ラウンドワン	20.8	19.5	25,213	東京都競馬	45	4.3	14,319						
リゾートトラスト	25.2	22.7	45,695	常盤興産	79	5.8	10,590						
ビー・エム・エル	8	7.5	17,992	カナモト	8.6	8.4	29,106						
りらいあコミュニケーション	11	10.7	14,113	東京ドーム	26	22.6	22,758						
リソー教育	—	12.9	10,797	西尾レントオール	5.1	4.9	18,571						
ユー・エス・エス	73	70.8	158,592	トランス・コスモス	7.6	6.8	17,081						
サイバーエージェント	16.2	36	120,600	乃村工藝社	13.9	13.5	34,276						
楽天	310.8	276.3	345,375	藤田観光	25	2.2	7,755						
デー・オー・ダブリュ	—	8.9	7,342	KNT-CTホールディングス	37	40	8,760						
セントラルスポーツ	3	3.2	13,072	日本管財	6.2	5.2	10,550						
フルキャストホールディングス	8	6	11,598	トーカイ	3.1	2.7	13,230						
テクノプロ・ホールディング	10.3	10	52,800	セコム	63.4	60.3	502,057						
ジャパンマテリアル	3.2	4.5	13,234	セントラル警備保障	—	3.5	7,301						

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

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

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

項目	当期末	
	貸付	借入
株式	株 2,246,000 (392,600)	株 — (—)

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
(注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券へ392,600株を貸付
けています。

■投資信託財産の構成

2017年9月19日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 135,585,875	% 96.2
コール・ローン等、その他	5,343,291	3.8
投資信託財産総額	140,929,166	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年9月19日現在

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

*期首における元本額は143,240,630,767円、当期中における追加設定元本額は
15,781,466,537円、同解約元本額は26,029,216,564円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、トピ
ックス・インデックスファンド4,876,025,306円、ダイワ・トピックス・インデッ
クスファンドV A12,004,610,396円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックス
インデックスファンドV A2 63,814,361円、ダイワ国内重視バランスファンド30
V A (一般投資家私募) 98,324,013円、ダイワ国内重視バランスファンド50V A
(一般投資家私募) 1,596,875,323円、ダイワ国際分散バランスファンド30V A
(一般投資家私募) 73,496,283円、ダイワ国際分散バランスファンド50V A (一
般投資家私募) 2,267,542,428円、D-1's TOPIXインデックス29,570,535

円、為替ヘッジ付米国債プラス日本株式ファンド27,492,055円、DCダイワ・
ターゲットイヤー2050 571,628円、iFree TOPIXインデックス219,320,903
円、iFree 8資産バランス560,747,176円、DCダイワ日本株式インデックス
61,209,294,542円、ダイワ・ライフ・バランス30 2,305,738,742円、ダイワ・ライ
フ・バランス50 2,363,094,190円、ダイワ・ライフ・バランス70 2,234,782,816
円、年金ダイワ日本株式インデックス3,968,008,120円、DCダイワ・ターゲッ
トイヤー2020 20,185,626円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 59,526,245円、
DCダイワ・ターゲットイヤー2040 12,595,154円、ダイワ世界分散バランスファ
ンド15V A404,752円、ダイワ世界分散バランスファンド20V A400,556円、ダイ
ワ世界分散バランスファンド20V A (国内株式型) 753,865円、ダイワ世界分散バ
ランスファンド25V A11,529,912円、ダイワ世界分散バランスファンド30V A
47,889,757円、ダイワ世界分散バランスファンド30V A (国内株式型)
27,538,772円、ダイワ世界分散バランスファンド40V A532,798,059円、ダイワ世界バ
ランスファンド60V A191,358,243円、ダイワ・バランスファンド35V A
11,883,395,819円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50V A319,015,775円、
ダイワ・ワールド・バランスファンド75V A481,942,796円、ダイワ・バランス
ファンド25V A (適格機関投資家専用) 1,022,475,874円、ダイワ国内バランス
ファンド25V A (適格機関投資家専用) 148,071,718円、ダイワ国内バランスファ
ンド30V A (適格機関投資家専用) 256,045,701円、ダイワ・ノーロードTOPIX
ファンド58,249,473円、ダイワファンドラップTOPIXインデックス
5,574,613,851円、ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)
4,252,692円、ダイワファンドラップオンラインTOPIXインデックス
963,778,473円、ダイワ・インデックスセレクトTOPIX1,204,591,549円、ダイ
ワライフスタイル25 192,618,067円、ダイワライフスタイル50 643,116,079
円、ダイワライフスタイル75 521,030,501円、DC・ダイワ・トピックス・イン
デックス (確定拠出年金専用ファンド) 14,915,392,614円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は10,279円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月21日 至2017年9月19日

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

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

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果を日経平均株価（日経225）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主 要 投 資 対 象	ベビーファンド	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券
	ストックインデックス225・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄
マザーファンドの運用方法	投資成果を日経平均株価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、等株数投資を行ないます。 （ロ）株式の組入比率は、高位を保ちます。	
組 入 制 限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

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

運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2018年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ 日経225インデックス」は、このたび、第2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/>

<4642>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価 (ベンチマーク)		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期 中 騰落率	期 中 騰落率	期 中 騰落率	期 中 騰落率			
1 期末(2017年 6 月15日)	円	円	%	円	%	%	%	百万円
	12,007	0	20.1	19,831.82	18.4	98.2	1.8	3,303
2 期末(2018年 6 月15日)	14,057	0	17.1	22,851.75	15.2	98.3	1.7	6,623

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

(注2) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークは日経平均株価です。

■ 基準価額・騰落率

期 首：12,007円

期 末：14,057円

騰落率：17.1%

■ 基準価額の主な変動要因

日経平均株価への連動をめざした運用を行なった結果、国内株式市況が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期首)2017年6月15日	円	%	円	%	%	%
	12,007	—	19,831.82	—	98.2	1.8
6月末	12,143	1.1	20,033.43	1.0	98.2	1.8
7月末	12,074	0.6	19,925.18	0.5	98.8	1.2
8月末	11,909	△ 0.8	19,646.24	△ 0.9	98.4	1.7
9月末	12,414	3.4	20,356.28	2.6	97.2	2.8
10月末	13,425	11.8	22,011.61	11.0	98.1	1.9
11月末	13,860	15.4	22,724.96	14.6	97.5	2.4
12月末	13,899	15.8	22,764.94	14.8	97.7	2.3
2018年1月末	14,100	17.4	23,098.29	16.5	98.0	1.9
2月末	13,480	12.3	22,068.24	11.3	97.8	2.2
3月末	13,199	9.9	21,454.30	8.2	97.9	2.1
4月末	13,824	15.1	22,467.87	13.3	98.0	2.0
5月末	13,659	13.8	22,201.82	12.0	97.5	2.5
(期末)2018年6月15日	14,057	17.1	22,851.75	15.2	98.3	1.7

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

国内株式市況

国内株式市況は、期首より、欧米の中央銀行の金融引き締めペースの見方が交錯し、横ばい圏で推移しました。2017年9月半ば以降は、米国の2017年内の利上げ観測が再び高まり円安米ドル高となったことや北朝鮮問題への懸念が一服したこと、10月に行なわれた衆議院議員選挙で連立与党が勝利したことなどを受け、株価は上昇しました。しかし、2018年2月に米国長期金利が急上昇したこと、また3月に米国が新たな関税を課す方針を示し貿易摩擦激化への懸念が高まったことにより、株価は下落しました。4月に入ると、米中貿易摩擦懸念の後退や米国金利上昇による円安進行を受け株価は上昇したものの、5月後半には、米国が自動車・同部品への関税引き上げを検討する調査を開始したことや、イタリアにおける政治不安の高まりが懸念され、株価は下落しました。6月に入ると、米国株式市場の上昇や円安に転じたことなどを背景に、期末にかけて上昇しました。

前期における「今後の運用方針」

当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマーク（日経平均株価）に連動する投資成果をめざして「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れて運用を行なってまいります。

ストックインデックス225・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（日経平均株価）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

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■当ファンド

「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れて運用を行ないました。

■ストックインデックス225・マザーファンド

株式の組み入れを中心に、日経平均先物取引も一部利用し、期を通じて、実質株式組入比率をおおむね99%程度以上の水準に維持しました。

株式ポートフォリオにつきましては、日経平均株価採用銘柄のうち当社独自の基準で財務リスクが高いと判断される銘柄を除いた残りすべての銘柄に投資を行ない、日経平均株価の動きに連動するように、ポートフォリオを構築し運用しております。当期につきましては、東芝が日経平均株価採用銘柄より除外された2017年8月からは、すべての銘柄を組み入れて運用を行ないました。

また、日経平均株価採用銘柄の入れ替え時には、その都度、組入銘柄の入れ替えを行ない、連動性の維持に努めました。

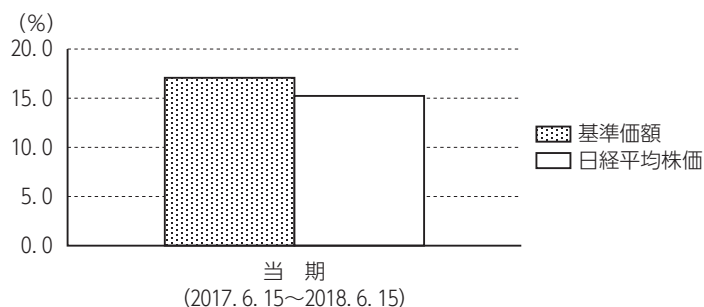
ベンチマークとの差異について

当期のベンチマーク（日経平均株価）の騰落率は15.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は17.1%となりました。

ほぼ100%組み入れているマザーファンドに組入銘柄の配当金が計上されたのに対し、ベンチマークである日経平均株価には配当金の影響が考慮されていないことが、プラスのかい離要因となりました。

また、ファンドから信託報酬等コストが控除されたことがマイナス要因となりました。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2017年6月16日 ~2018年6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	4,056

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



今後の運用方針

■当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークに連動する投資成果をめざして「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れて運用を行なってまいります。

■ストックインデックス225・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 (2017. 6. 16~2018. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	44円	0.335%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は13,167円です。
（投 信 会 社）	(27)	(0.205)	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）	(14)	(0.108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 銀 行）	(3)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 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)	(0.002)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.006	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
（監 査 費 用）	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	45	0.342	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ストックインデックス225・マザーファンド	1,208,817	3,136,305	227,040	608,345

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

項 目	当 期	
	口 数	金 額
(a) 期中の株式売買金額	57,367,706千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	137,906,221千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.41	

(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等

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況 D	D/C
株式	27,758	3,563	12.8	29,609	3,164	10.7
株式先物取引	43,355	—	—	43,661	—	—
コール・ローン	527,988	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合3.5%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
株式	28	34	160

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

種 類	当 期	
	買 付 額	期末保有額
株式	319	319

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ストックインデックス225・マザーファンド	1,388,712	2,370,489	6,622,436

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ストックインデックス225・マザーファンド	6,622,436	98.6
コール・ローン等、その他	92,625	1.4
投資信託財産総額	6,715,061	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

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	6,715,061,731円
コール・ローン等	27,395,062
ストックインデックス225・マザーファンド(評価額)	6,622,436,669
未収入金	65,230,000
(B) 負債	91,505,938
未払解約金	81,703,992
未払信託報酬	9,645,847
その他未払費用	156,099
(C) 純資産総額(A-B)	6,623,555,793
元本	4,712,067,908
次期繰越損益金	1,911,487,885
(D) 受益権総口数	4,712,067,908口
1万口当り基準価額(C/D)	14,057円

*期首における元本額は2,751,053,801円、当期中における追加設定元本額は2,980,382,583円、同解約元本額は1,019,368,476円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は14,057円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 4,956円
受取利息	669
支払利息	△ 5,625
(B) 有価証券売買損益	675,423,629
売買益	789,276,499
売買損	△ 113,852,870
(C) 信託報酬等	△ 16,718,680
(D) 当期損益金 (A + B + C)	658,699,993
(E) 前期繰越損益金	128,856,806
(F) 追加信託差損益金	1,123,931,086
(配当等相当額)	(163,196,419)
(売買損益相当額)	(960,734,667)
(G) 合計 (D + E + F)	1,911,487,885
次期繰越損益金 (G)	1,911,487,885
追加信託差損益金	1,123,931,086
(配当等相当額)	(163,196,419)
(売買損益相当額)	(960,734,667)
分配準備積立金	787,561,755
繰越損益金	△ 4,956

- (注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
- (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
- (注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	658,704,212
(c) 収益調整金	1,123,931,086
(d) 分配準備積立金	128,857,543
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,911,492,841
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,911,492,841
(h) 受益権総口数	4,712,067,908口

【注記】

「日経平均株価」に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。また、「ダイワファンドラップ 日経225インデックス」について、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 日経 225インデックス）が投資対象としている「ストックインデックス 225・マザーファンド」の決算日（2017年9月19日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15日）現在におけるストックインデックス 225・マザーファンドの組入資産の内容等を27～28ページに併せて掲載いたしました。

■ストックインデックス 2 2 5 ・ マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
リクルートホールディングス	828	2,049,789	2,475	ファーストリテイリング	52	1,933,865	37,189
ファーストリテイリング	42	1,748,709	41,635	ソフトバンクグループ	156	1,447,383	9,278
セイコーエプソン	584	1,649,307	2,824	ファナック	52	1,239,887	23,843
ファナック	42	1,089,003	25,928	東京エレクトロン	52	942,883	18,132
ソフトバンクグループ	126	1,082,858	8,594	KDDI	312	935,475	2,998
東京エレクトロン	42	813,549	19,370	京セラ	104	736,670	7,083
KDDI	252	695,024	2,758	ダイキン工業	52	621,562	11,953
京セラ	84	533,245	6,348	信越化学	52	550,952	10,595
ダイキン工業	42	508,325	12,102	日東電工	52	499,295	9,601
信越化学	42	461,321	10,983	テルモ	104	499,035	4,798

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年6月15日現在におけるストックインデックス 2 2 5 ・ マザーファンド（55,624,307千円）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在	
	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
水産・農林業 (0.2%)			化学 (9.0%)			日本板硝子	24.8	27,428
日本水産	248	135,160	クラレ	248	409,944	日本電気硝子	74.4	236,592
マルハニチロ	24.8	108,004	旭化成	248	358,608	住友大阪セメント	248	131,440
鉱業 (0.1%)			昭和電工	24.8	123,008	太平洋セメント	24.8	100,564
国際石油開発帝石	99.2	116,510	住友化学	248	159,712	東海カーボン	248	526,008
建設業 (2.7%)			日産化学	248	1,277,200	TOTO	124	698,120
コムシスホールディングス	248	732,344	東ソー	124	224,068	日本碍子	248	498,976
大成建設	49.6	306,032	トクヤマ	49.6	184,264	鉄鋼 (0.2%)		
大林組	248	283,216	デンカ	49.6	192,696	新日鐵住金	24.8	55,924
清水建設	248	275,032	信越化学	248	2,586,640	神戸製鋼所	24.8	28,321
長谷工コーポレーション	49.6	79,806	三井化学	49.6	151,032	JFEホールディングス	24.8	56,568
鹿島建設	248	222,952	三菱ケミカル HLDGS	124	120,304	日新製鋼	24.8	39,208
大和ハウス	248	982,824	宇部興産	24.8	76,508	大平洋金属	24.8	98,952
積水ハウス	248	478,020	日本化薬	248	297,104	非鉄金属 (1.2%)		
日揮	248	540,888	花王	248	2,144,456	日本軽金属HD	248	62,992
千代田化工建	248	226,920	富士フイルム HLDGS	248	1,069,376	三井金属	24.8	127,720
食料品 (4.8%)			資生堂	248	2,230,264	東邦亜鉛	24.8	107,508
日清製粉G本社	248	594,208	日東電工	248	2,159,088	三菱マテリアル	24.8	77,996
明治ホールディングス	49.6	477,648	医薬品 (7.7%)			住友鉱山	124	571,640
日本ハム	124	562,340	協和発酵キリン	248	584,536	DOWAホールディングス	49.6	180,792
サッポロホールディングス	49.6	141,856	武田薬品	248	1,082,520	古河機金	24.8	40,548
アサヒグループホールディングス	248	1,414,096	アステラス製薬	1,240	2,192,320	古河電工	24.8	100,192
キリンHD	248	746,232	大日本住友製薬	248	586,520	住友電工	248	419,740
宝ホールディングス	248	362,080	塩野義製薬	248	1,434,928	フジクラ	248	187,488
キッコーマン	248	1,373,920	中外製薬	248	1,492,960	金属製品 (0.3%)		
味の素	248	535,060	エーザイ	248	2,027,152	SUMCO	24.8	58,255
ニチレイ	124	359,848	第一三共	248	996,216	東洋製罐グループHD	248	463,760
日本たばこ産業	248	784,920	大塚ホールディングス	248	1,357,552	機械 (5.0%)		
繊維製品 (0.3%)			石油・石炭製品 (0.4%)			日本製鋼所	49.6	152,272
東洋紡	24.8	45,706	昭和シェル石油	248	398,536	オークマ	49.6	298,592
ユニチカ	24.8	16,368	JXTGホールディングス	248	189,472	アマダホールディングス	248	280,736
帝人	49.6	103,465	ゴム製品 (0.9%)			小松製作所	248	841,464
東レ	248	220,174	横浜ゴム	124	299,088	住友重機械	49.6	190,464
パルプ・紙 (0.1%)			ブリヂストン	248	1,097,152	日立建機	248	922,560
王子ホールディングス	248	177,320	ガラス・土石製品 (1.6%)			クボタ	248	457,064
日本製紙	24.8	46,301	旭硝子	49.6	224,936	荏原製作所	49.6	174,840

銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在	
	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
ダイキン工業	248	3,297,160	陸運業 (2.4%)			MS & AD	74.4	264,789
日本精工	248	295,120	東武鉄道	49.6	178,808	SONY FH	49.6	105,648
NTN	248	115,568	東京急行	124	251,596	第一生命HLDGS	24.8	51,336
ジェイテクト	248	391,096	小田急電鉄	124	306,900	東京海上HD	124	691,176
日立造船	49.6	26,337	京王電鉄	49.6	270,816	T&Dホールディングス	49.6	87,172
三菱重工業	24.8	103,068	京成電鉄	124	490,420	その他金融業 (0.3%)		
IHI	24.8	101,060	東日本旅客鉄道	24.8	274,784	クレディセゾン	248	439,952
電気機器 (18.4%)			西日本旅客鉄道	24.8	203,409	不動産業 (1.7%)		
日清紡ホールディングス	248	310,496	東海旅客鉄道	24.8	595,696	東急不動産HD	248	198,648
コニカミノルタ	248	263,376	日本通運	24.8	222,208	三井不動産	248	680,140
ミネベアミツミ	248	484,840	ヤマトホールディングス	248	848,160	三菱地所	248	506,664
日立	248	202,839	海運業 (0.1%)			東京建物	124	191,456
三菱電機	248	377,208	日本郵船	24.8	58,032	住友不動産	248	1,061,440
富士電機	248	212,536	商船三井	24.8	72,912	サービス業 (4.3%)		
安川電機	248	1,040,360	川崎汽船	24.8	56,320	ディー・エヌ・エー	74.4	158,769
ジーエス・ユアサコーポ	248	125,488	空運業 (0.1%)			電通	248	1,304,480
日本電気	24.8	77,500	ANAホールディングス	24.8	110,360	楽天	248	180,444
富士通	248	175,658	倉庫・運輸関連業 (0.2%)			リクルートホールディングス	744	2,367,408
沖電気	24.8	31,074	三菱倉庫	124	295,120	日本郵政	248	308,264
セイコーエプソン	496	964,224	情報・通信業 (10.3%)			東京ドーム	124	123,504
パナソニック	248	388,368	ヤフー	99.2	37,795	セコム	248	2,050,960
ソニー	248	1,350,360	トレンドマイクロ	248	1,604,560			
TDK	248	2,849,520	スカパーJSATHD	24.8	12,871			
アルプス電気	248	694,896	日本電信電話	49.6	259,705			
パイオニア	248	39,928	KDDI	1,488	4,520,544			
横河電機	248	497,984	NTTドコモ	24.8	70,890			
アドバンテスト	496	1,151,712	東宝	24.8	93,496			
カシオ	248	422,344	NTTデータ	1,240	1,595,880			
ファナック	248	5,612,240	コナミホールディングス	248	1,371,440			
京セラ	496	3,243,840	ソフトバンクグループ	744	6,193,056			
太陽誘電	248	727,880	卸売業 (2.3%)					
SCREENホールディングス	49.6	427,552	双日	24.8	10,217			
キャノン	372	1,395,744	伊藤忠	248	529,356			
リコー	248	251,472	丸紅	248	217,272			
東京エレクトロン	248	4,731,840	豊田通商	248	977,120			
輸送用機器 (6.0%)			三井物産	248	476,160			
デンソー	248	1,372,680	住友商事	248	473,680			
三井E&SHD	24.8	36,679	三菱商事	248	794,840			
川崎重工業	24.8	84,692	小売業 (12.4%)					
日産自動車	248	270,568	J.フロントリテイリング	124	225,556			
いすゞ自動車	124	189,224	三越伊勢丹HD	248	353,400			
トヨタ自動車	248	1,875,376	セブン&アイ・HLDGS	248	1,226,608			
日野自動車	248	300,328	ユニ・ファミリーマートHD	248	2,988,400			
三菱自動車工業	24.8	21,873	高島屋	248	234,360			
マツダ	49.6	70,680	丸井グループ	248	595,200			
本田技研	496	1,752,368	イオン	248	597,804			
スズキ	248	1,594,144	ファーストリテイリング	248	12,734,800			
SUBARU	248	840,472	銀行業 (0.9%)					
ヤマハ発動機	248	748,960	コンコルディア・フィナンシャル	248	158,968			
精密機器 (3.3%)			新生銀行	24.8	43,623			
テルモ	496	3,333,120	あおぞら銀行	24.8	108,996			
ニコン	248	446,896	三菱UFJフィナンシャルG	248	163,357			
オリンパス	248	1,024,240	りそなホールディングス	24.8	16,196			
シチズン時計	248	181,040	三井住友トラストHD	24.8	114,452			
その他製品 (1.3%)			三井住友フィナンシャルG	24.8	112,294			
凸版印刷	248	222,456	千葉銀行	248	214,520			
大日本印刷	124	306,156	ふくおかフィナンシャルG	248	149,792			
ヤマハ	248	1,473,120	静岡銀行	248	272,056			
電気・ガス業 (0.2%)			みずほフィナンシャルG	248	47,591			
東京電力HD	24.8	12,573	証券・商品先物取引業 (0.4%)					
中部電力	24.8	42,048	大和証券G本社	248	160,927			
関西電力	24.8	40,300	野村ホールディングス	248	140,417			
東京瓦斯	49.6	148,527	松井証券	248	261,888			
大阪瓦斯	49.6	116,733	保険業 (1.0%)					
			SOMPOホールディングス	62	286,006			

合計		株数	金額	株数	金額
株数	43,015.6	株数	152,731,980	株数	152,731,980
銘柄数<比率>	225銘柄	銘柄数<比率>	<98.3%>	銘柄数<比率>	<98.3%>

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

(2)先物取引の銘柄別残高(評価額)

銘柄別	2018年6月15日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
日経平均	2,671	—

(注) 単位未満は切捨て。

ストックインデックス225・マザーファンド

運用報告書 第16期 (決算日 2017年9月19日)

(計算期間 2016年9月21日～2017年9月19日)

ストックインデックス225・マザーファンドの第16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、日経平均株価をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄
運用方法	投資成果を日経平均株価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、等株数投資を行ないます。 ロ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。
株式組入制限	無制限

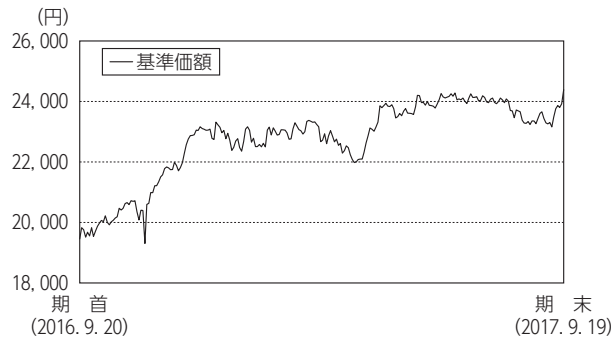
大和投資信託

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



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

◆前期における「今後の運用方針」

当ファンドの運用方針に基づき、日経平均株価に連動する投資成果をめざして運用を行なっておりま

◆ポートフォリオについて

株式の組み入れを中心に、日経平均先物取引も一部利用し、期を通じて、実質株式組入比率をおおむね99%程度以上の水準に維持しました。

株式ポートフォリオにつきましては、日経平均株価採用銘柄のうち当社独自の基準で財務リスクが高いと判断される銘柄を除いた残りすべての銘柄に投資を行ない、日経平均株価の動きに連動するように、ポートフォリオを構築し運用しております。当期につきましては、期中に東芝の組み入れを見送り、東芝が日経平均株価採用銘柄より除外された2017年8月からは、すべての銘柄を組み入れて運用を行ないました。

また、日経平均株価採用銘柄の入れ替え時には、その都度、組入銘柄の入れ替えを行ない、連動性の維持に努めました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率は23.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は25.4%となりました。

・ファンドには保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークである日経平均株価では配当金の影響が考慮されないことが、プラス要因となりました。
・資金の流出に伴う現物株式および株式先物の売買等によるコスト負担が、マイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用方針に基づき、日経平均株価に連動する投資成果をめざして運用を行なっておりま

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：19,454円 期末：24,389円 騰落率：25.4%

【基準価額の主な変動要因】

日経平均株価への連動をめざした運用を行なった結果、日経平均株価の動きを反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、日米の金融政策や米国大統領選挙に

■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 (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)株 式 (2016年9月21日から2017年9月19日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 3,950.7 (△3,287.208)	千円 10,431,718 (—)	千株 23,815.192	千円 58,750,439

(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

(2016年9月21日から2017年9月19日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 株式先物取引	百万円 41,135	百万円 41,561	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

(2016年9月21日から2017年9月19日まで)

買 付	当 期			期 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
	大塚ホールディングス	304	1,566,467	5,152	ファーストリテイリング	116	4,514,726	38,920
	セイコーエプソン	512	1,498,606	2,926	ソフトバンクグループ	348	2,798,374	8,041
	楽天	366	480,247	1,312	ファナック	116	2,446,606	21,091
	ファーストリテイリング	14	468,201	33,442	KDDI	696	2,092,719	3,006
	ソフトバンクグループ	42	342,411	8,152	東京エレクトロン	116	1,451,911	12,516
	ファナック	14	300,506	21,464	京セラ	232	1,402,729	6,046
	KDDI	84	249,664	2,972	ダイキン工業	116	1,259,896	10,861
	東京エレクトロン	14	181,383	12,955	信越化学	116	1,078,234	9,295
	京セラ	28	173,759	6,205	日東電工	116	1,018,089	8,776
	ダイキン工業	14	151,488	10,820	テルモ	232	980,424	4,225

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内株式

銘 柄	期 首			当 期 末			銘 柄	期 首			当 期 末			銘 柄	期 首			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		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		千株	千株	千円		千株	千株	千円	
水産・農林業 (0.2%)							繊維製品 (0.3%)													
日本水産	352	250	154,000				ニチレイ	352	125	361,250				花王	352	250	1,711,000			
マルハニチロ	35.2	25	82,875				日本たばこ産業	352	250	930,000				富士フィルム HLDGS	352	250	1,095,750			
鉱業 (0.1%)							東洋紡	352	250	49,750				資生堂	352	250	1,147,500			
国際石油開発帝石	140.8	100	111,150				ユニチカ	352	250	20,750				日東電工	352	250	2,441,250			
建設業 (2.9%)							帝人	352	50	114,550				医薬品 (7.5%)						
コムシスホールディングス	352	250	635,500				東レ	352	250	271,375				協和発酵キリン	352	250	466,000			
大成建設	352	250	293,000				パルプ・紙 (0.3%)							武田薬品	352	250	1,547,750			
大林組	352	250	325,000				王子ホールディングス	352	250	148,750				アステラス製薬	1,760	1,250	1,832,500			
清水建設	352	250	299,750				日本製紙	35.2	25	51,950				大日本住友製薬	352	250	369,750			
長谷工コーポレーション	70.4	50	70,550				北越紀州製紙	352	250	173,000				塩野義製薬	352	250	1,489,750			
鹿島建設	352	250	259,500				化学 (9.3%)							中外製薬	352	250	1,165,000			
大和ハウス	352	250	962,250				クラレ	352	250	532,000				エーザイ	352	250	1,467,250			
積水ハウス	352	250	466,375				旭化成	352	250	349,750				第一三共	352	250	652,500			
日揮	352	250	433,000				昭和電工	35.2	25	84,125				大塚ホールディングス	—	250	1,094,500			
千代田化工建	352	250	153,000				住友化学	352	250	176,750				石油・石炭製品 (0.3%)						
食料品 (4.9%)							日産化学	352	250	1,020,000				昭和シエル石油	352	250	305,250			
日清製粉G本社	352	250	489,750				日本曹達	352	—	—				JXTGホールディングス	352	250	141,425			
明治ホールディングス	70.4	50	437,000				東ソー	352	250	324,000				ゴム製品 (1.1%)						
日本ハム	352	250	786,250				トクヤマ	352	250	129,750				横浜ゴム	176	125	280,625			
サッポロホールディングス	70.4	50	159,500				デンカ	352	250	183,250				ブリヂストン	352	250	1,256,250			
アサヒグループホールディング	352	250	1,146,000				信越化学	352	250	2,540,000				ガラス・土石製品 (1.6%)						
キリンHD	352	250	632,750				三井化学	352	250	173,750				旭硝子	352	50	208,250			
宝ホールディングス	352	250	266,000				三菱ケミカル HLDGS	176	125	135,187				日本板硝子	352	25	21,250			
キッコーマン	352	250	878,750				宇部興産	352	250	83,250				日本電気硝子	528	75	318,750			
味の素	352	250	542,375				日本化薬	352	250	454,000				住友大阪セメント	352	250	125,000			
														太平洋セメント	352	250	109,750			

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
千円					千円					千円				
東海カーボン	352		250	225,000	輸送用機器 (6.7%)					セブン&アイ・HLDGS	352		250	1,101,750
TOTO	176		125	551,875	デンソー	352		250	1,375,500	ユニー・ファミリーマートHD	352		250	1,432,500
日本碍子	352		250	531,000	三井造船	352		250	35,500	高島屋	352		250	260,750
鉄鋼 (0.2%)					川崎重工業	352		250	91,750	丸井グループ	352		250	406,750
新日鐵住金	35.2	25	67,800	日産自動車	352		250	288,250	イオン	352		250	409,625	
神戸製鋼所	352		25	33,575	いすゞ自動車	176		125	186,312	ファーストリテイリング	352		250	8,200,000
JFEホールディングス	35.2	25	55,887	トヨタ自動車	352		250	1,682,250	銀行業 (1.0%)					
日新製鋼	35.2	25	35,525	日野自動車	352		250	340,000	コンソルディア・フィナンシャル	352		250	139,525	
大平洋金属	352		250	78,000	三菱自動車工業	35.2	25	21,625	新生銀行	352		250	43,750	
非鉄金属 (1.5%)					マツダ	70.4	50	82,950	あおぞら銀行	352		250	106,750	
日本軽金属HD	352		250	82,750	本田技研	704	500	1,647,000	三菱UFJフィナンシャルG	352		250	177,225	
三井金属	352		250	149,000	スズキ	352		250	1,532,000	りそなホールディングス	35.2	25	13,822	
東邦亜鉛	352		250	122,500	SUBARU	352		250	995,000	三井住友トラストHD	352		25	99,375
三菱マテリアル	352		25	99,250	ヤマハ発動機	352		250	818,750	三井住友フィナンシャルG	35.2	25	107,200	
住友鉱山	352		250	489,000	精密機器 (2.9%)					千葉銀行	352		250	190,250
DOWAホールディングス	352		250	205,750	デルモ	704	500	2,262,500	ふくおかフィナンシャルG	352		250	122,000	
古河機金	352		250	48,750	ニコン	352		250	472,500	静岡銀行	352		250	249,000
古河電工	352		25	157,250	オリンパス	352		250	966,250	みずほフィナンシャルG	352		250	48,950
住友電工	352		250	443,750	シチズン時計	352		250	194,750	証券・商品先物取引業 (0.4%)				
フジクラ	352		250	231,250	その他製品 (1.2%)					大和証券G本社	352		250	158,525
金属製品 (0.4%)					凸版印刷	352		250	278,500	野村ホールディングス	352		250	157,925
SUMCO	35.2	25	42,700	大日本印刷	352		250	331,250	松井証券	352		250	215,000	
東洋製罐グループHD	352		250	477,250	ヤマハ	352		250	977,500	保険業 (1.0%)				
機械 (5.3%)					電気・ガス業 (0.2%)					SOMPOホールディングス	88	62.5	283,062	
日本製鋼所	352		50	130,750	東京電力HD	35.2	25	11,450	MS&AD	105.6	75	273,750		
オークマ	352		250	281,500	中部電力	35.2	25	35,962	SONYFH	70.4	50	89,100		
アマダホールディングス	352		250	310,500	関西電力	35.2	25	38,512	第一生命HLDGS	35.2	25	47,487		
小松製作所	352		250	792,000	東京瓦斯	352		250	143,625	東京海上HD	176	125	565,625	
住友重機械	352		250	223,250	大阪瓦斯	352		250	107,125	T&Dホールディングス	70.4	50	78,375	
日立建機	352		250	808,750	陸運業 (2.2%)					その他金融業 (0.4%)				
クボタ	352		250	503,500	東武鉄道	352		250	156,250	クレディセゾン	352		250	513,750
荏原製作所	352		50	182,750	東京急行	352		125	200,625	不動産業 (1.7%)				
ダイキン工業	352		250	2,828,750	小田急電鉄	352		125	267,625	東急不動産HD	352		250	164,250
日本精工	352		250	365,500	京王電鉄	352		250	234,750	三井不動産	352		250	584,250
NTN	352		250	117,500	京成電鉄	352		125	388,125	三菱地所	352		250	475,000
ジェイテクト	352		250	382,750	東日本旅客鉄道	35.2	25	254,875	東京建物	176	125	172,875		
日立造船	70.4	50	28,800	西日本旅客鉄道	35.2	25	196,925	住友不動産	352		250	859,750		
三菱重工業	352		250	109,175	東海旅客鉄道	35.2	25	485,875	サービス業 (2.9%)					
IHI	352		250	96,250	日本通運	352		250	185,250	ディー・エヌ・エー	105.6	75	182,775	
電気機器 (19.9%)					ヤマトホールディングス	352		250	579,000	電通	352		250	1,178,750
日清紡ホールディングス	352		250	331,750	海運業 (0.2%)					楽天	—	250	312,500	
コニカミノルタ	352		250	232,500	日本郵船	352		250	58,000	東京ドーム	176	125	125,875	
ミネベアミツミ	352		250	474,750	商船三井	352		250	87,750	セコム	352		250	2,081,500
日立	352		250	198,275	川崎汽船	352		250	73,250					
東芝	352		—	—	空運業 (0.1%)					千株		千株		千円
三菱電機	352		250	438,750	ANAホールディングス	352		250	104,925	合計	株数、金額	73,339.2	50,187.5	134,894,422
富士電機	352		250	157,000	倉庫・運輸関連業 (0.3%)					銘柄数<比率>		225銘柄	225銘柄	<97.2%>
安川電機	352		250	902,500	三菱倉庫	352		250	349,000					
明電舎	352		250	100,750	情報・通信業 (11.8%)									
ジーエス・ユアサコーポ	352		250	145,500	ヤフー	140.8	100	50,600						
日本電気	352		250	74,750	トレンドマイクロ	352		250	1,402,500					
富士通	352		250	211,525	スカパーJSATHD	35.2	25	12,650						
沖電気	352		25	37,600	日本電信電話	70.4	50	256,750						
セイコーエプソン	—	500	1,411,500	KDDI	2,112	1,500	4,471,500							
パナソニック	352		250	412,875	NTTドコモ	35.2	25	64,587						
ソニー	352		250	1,073,500	東宝	35.2	25	98,250						
TDK	352		250	1,880,000	NTTデータ	352	1,250	1,500,000						
ミツミ電機	352		—	—	コナミホールディングス	352		250	1,407,500					
アルプス電気	352		250	758,750	ソフトバンクグループ	1,056	750	6,678,000						
パイオニア	352		250	51,500	卸売業 (2.3%)									
横河電機	352		250	471,750	双日	35.2	25	7,675						
アドバンテスト	704	500	1,058,500	伊藤忠	352		250	458,250						
カシオ	352		250	394,250	丸紅	352		250	185,725					
ファナック	352		250	5,688,750	豊田通商	352		250	915,000					
京セラ	704	500	3,491,500	三井物産	352		250	421,625						
太陽誘電	352		250	435,500	住友商事	352		250	402,125					
SCREENホールディングス	352		50	380,000	三菱商事	352		250	655,125					
キャノン	528	375	1,438,875	小売業 (9.1%)										
リコー	352		250	275,000	J.フロントリテイリング	176		125	187,125					
東京エレクトロン	352		250	4,307,500	三越伊勢丹HD	352		250	287,500					

■投資信託財産の構成

2017年9月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	134,894,422	96.9
コール・ローン等、その他	4,323,590	3.1
投資信託財産総額	139,218,012	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年9月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	140,008,002,801円
コール・ローン等	1,979,025,274
株式(評価額)	134,894,422,500
未収入金	2,254,062,027
未収配当金	90,503,000
差入委託証拠金	789,990,000
(B) 負債	1,251,758,000
未払解約金	385,458,000
差入委託証拠金代用有価証券	866,300,000
(C) 純資産総額(A-B)	138,756,244,801
元本	56,891,999,288
次期繰越損益金	81,864,245,513
(D) 受益権総口数	56,891,999,288口
1万口当り基準価額(C/D)	24,389円

* 期首における元本額は78,725,801,897円、当期中における追加設定元本額は9,750,934,005円、同解約元本額は31,584,736,614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、ストックインデックスファンド225 29,839,637,905円、適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド225 V A934,940,216円、大和ストックインデックス225ファンド10,398,001,066円、D-1's 日経225インデックス102,430,549円、iFree 日経225インデックス103,304,273円、DC・ダイワ・ストックインデックス225(確定拠出年金専用ファンド)5,031,285,400円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト12Ver2-227,152,665円、ダイワ・ノーロード日経225ファンド155,766,009円、ダイワファンドラップ日経225インデックス1,669,599,472円、ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)428,154円、ダイワ・インデックスセレクト日経225 8,429,453,579円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,389円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月21日 至2017年9月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,774,846,036円
受取配当金	2,775,725,064
その他収益金	436,564
支払利息	△ 1,315,592
(B) 有価証券売買損益	32,230,575,612
売買益	34,058,409,010
売買損	△ 1,827,833,398
(C) 先物取引等損益	753,493,940
取引益	917,437,479
取引損	△ 163,943,539
(D) その他費用	△ 224,792
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	35,758,690,796
(F) 前期繰越損益金	74,425,073,074
(G) 解約差損益金	△ 40,378,052,352
(H) 追加信託差損益金	12,058,533,995
(I) 合計(E+F+G+H)	81,864,245,513
次期繰越損益金(I)	81,864,245,513

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

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

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

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

運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2018年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）」は、このたび、第2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/>

<2731>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率						
1 期末 (2017年 6 月 15 日)	円 11,194	円 0	% 11.9	円 11,071	% 10.7	% 93.4	% 3.8	% 0.0	% 2.4	百万円 16,740
2 期末 (2018年 6 月 15 日)	円 12,400	円 0	% 10.8	円 12,054	% 8.9	% 95.8	% 3.4	% —	% 2.3	百万円 31,820

(注1) MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) をもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

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

(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) です。

■ 基準価額・騰落率

期首：11,194円

期末：12,400円

騰落率：10.8%

■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドの受益証券を通じてベンチマーク (MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)) の動きに連動させることをめざして運用を行なった結果、米国株式市場における景気拡大や税制改革への期待などを好感して外国株式市況が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首)2017年6月15日	11,194	—	11,071	—	93.4	3.8	0.0	2.4
6月末	11,094	△ 0.9	10,961	△ 1.0	95.9	3.5	0.0	2.5
7月末	11,244	0.4	11,106	0.3	94.2	2.4	0.0	2.6
8月末	11,179	△ 0.1	11,015	△ 0.5	95.3	2.3	0.0	2.7
9月末	11,436	2.2	11,256	1.7	97.3	2.7	0.0	2.6
10月末	11,709	4.6	11,521	4.1	94.9	2.7	0.0	2.5
11月末	11,851	5.9	11,640	5.1	92.8	3.6	0.0	2.5
12月末	12,059	7.7	11,831	6.9	94.5	4.2	0.0	2.5
2018年1月末	12,466	11.4	12,232	10.5	92.1	3.4	0.0	2.3
2月末	12,135	8.4	11,886	7.4	91.8	3.6	0.0	2.2
3月末	11,725	4.7	11,467	3.6	92.3	4.7	0.0	2.3
4月末	11,942	6.7	11,660	5.3	95.9	4.1	0.0	2.4
5月末	12,152	8.6	11,824	6.8	94.4	1.8	—	2.3
(期末)2018年6月15日	12,400	10.8	12,054	8.9	95.8	3.4	—	2.3

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017.6.16～2018.6.15)

■外国株式市況

米国・欧州を中心とする外国株式市況は、期首より横ばいでの推移となりましたが、その後は米国企業の好調な決算発表や米国長期金利の上昇一服などから堅調に推移しました。2017年9月には、北朝鮮による6回目の核実験や米国南部に襲来した大型ハリケーンなど投資家心理が悪化する場面もありましたが、良好な決算発表や景況感の改善などを背景に、市況は底堅く推移しました。2018年1月には、米国株式市場が景気拡大や税制改革を好感して上昇したことで、市況はさらに上値を追う展開となりました。2月以降は、米国の利上げ加速への警戒感などから市況は下落し、その後も米中貿易摩擦が激化することへの懸念などを嫌気し、上値の重い展開となりました。5月以降も、米中貿易摩擦への懸念やイタリア政局の混迷などの悪材料を受け、力強さに欠ける展開のまま期末を迎えました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース））の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なっています。また、保有実質外貨建資産については、為替ヘッジを行ないません。

ポートフォリオについて

（2017. 6. 16～2018. 6. 15）

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

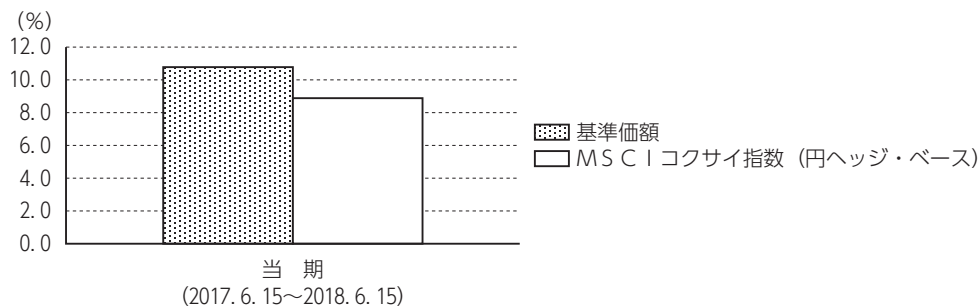
ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式（リート、株式先物を含む。）のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

当期のベンチマークの騰落率は8.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は10.8%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、ベンチマークには配当分が含まれていないことが、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、為替ヘッジにかかるコスト、信託報酬・売買委託手数料や保管費用等のコスト負担がかい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2017年6月16日 ～2018年6月15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)	2,400	

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。また、保有実質外貨建資産については、為替ヘッジを行ないます。

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2017. 6. 16~2018. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	51円	0.437%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,760円です。
（投信会社）	(36)	(0.308)	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）	(13)	(0.108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託銀行）	(3)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	2	0.013	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(1)	(0.011)	
（先物）	(0)	(0.002)	
（投資信託受益証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	3	0.023	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）	(3)	(0.023)	
（投資信託受益証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
その他費用	9	0.072	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）	(7)	(0.063)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	(0)	(0.004)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	64	0.546	

（注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

（注2）金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	7,524,142	13,503,790	557,021	994,310

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

項 目	当 期
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	13,559,474千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	26,812,201千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.50

(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等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	当 期 末		
	期 首	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	9,834,242	16,801,363	31,815,061

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	31,815,061	99.7
コール・ローン等、その他	100,483	0.3
投資信託財産総額	31,915,545	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.68円、1カナダ・ドル=84.33円、1オーストラリア・ドル=82.53円、1香港ドル=14.10円、1シンガポール・ドル=82.20円、1ニュージーランド・ドル=76.93円、1イギリス・ポンド=146.66円、1イスラエル・シェケル=30.62円、1スイス・フラン=110.92円、1デンマーク・クローネ=17.17円、1ノルウェー・クローネ=13.60円、1スウェーデン・クローネ=12.64円、1ユーロ=127.90円です。

(注3) 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(35,989,154千円)の投資信託財産総額(36,608,306千円)に対する比率は、98.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	31,915,545,622円
コール・ローン等	100,483,754
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	31,815,061,868
(B) 負債	95,014,092
未払解約金	32,524,952
未払信託報酬	61,725,725
その他未払費用	763,415
(C) 純資産総額(A-B)	31,820,531,530
元本	25,661,230,421
次期繰越損益金	6,159,301,109
(D) 受益権総口数	25,661,230,421口
1万口当り基準価額(C/D)	12,400円

* 期首における元本額は14,953,852,748円、当期中における追加設定元本額は15,243,885,793円、同解約元本額は4,536,508,120円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,400円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 36,262円
受取利息	3,136
支払利息	△ 39,398
(B) 有価証券売買損益	2,357,316,577
売買益	2,571,627,123
売買損	△ 214,310,546
(C) 信託報酬等	△ 106,491,079
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,250,789,236
(E) 前期繰越損益金	882,739,508
(F) 追加信託差損益金	3,025,772,365
(配当等相当額)	(1,013,554,664)
(売買損益相当額)	(2,012,217,701)
(G) 合計(D+E+F)	6,159,301,109
次期繰越損益金(G)	6,159,301,109
追加信託差損益金	3,025,772,365
(配当等相当額)	(1,013,554,664)
(売買損益相当額)	(2,012,217,701)
分配準備積立金	3,133,565,006
繰越損益金	△ 36,262

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

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

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	2,250,820,186
(c) 収益調整金	3,025,772,365
(d) 分配準備積立金	882,744,820
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	6,159,337,371
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	6,159,337,371
(h) 受益権総口数	25,661,230,421口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（2018年1月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を39～57ページに併せて掲載いたしました。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC (アメリカ)	16.042	293,750	18,311	APPLE INC (アメリカ)	1.35	23,802	17,631
MICROSOFT CORP (アメリカ)	23.422	219,629	9,377	ACTELION LTD-REG (スイス)	0.625	19,908	31,853
AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.368	192,631	140,812	BRITISH AMERICAN TOB-SP ADR (イギリス)	2.681	19,286	7,193
FACEBOOK INC-A (アメリカ)	8.518	162,726	19,103	JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	1.2	18,047	15,039
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	9.034	132,789	14,698	MICROSOFT CORP (アメリカ)	1.95	16,649	8,537
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	14.726	128,592	8,732	FACEBOOK INC-A (アメリカ)	0.85	16,465	19,371
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	10.628	121,889	11,468	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.13	14,224	109,415
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.985	112,246	113,955	NESTLE SA-REG (スイス)	1.2	11,436	9,530
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.951	108,535	114,127	CHRISTIAN DIOR SE (フランス)	0.356	11,069	31,094
BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	32.027	99,352	3,102	GKN PLC (イギリス)	15.154	10,601	699

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年6月15日現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（19,059,528千円）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	株数	2018年6月15日現在		業 種 等
		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	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	11	126	13,987	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	8	172	19,086	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	16.59	101	11,241	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5.5	97	10,788	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	62	218	24,195	金融
ABBOTT LABORATORIES	150.97	950	105,202	ヘルスケア
ARCONIC INC	39.5	71	7,869	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	11.35	124	13,814	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	34	274	30,330	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	24	218	24,225	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	27.5	296	32,786	情報技術
QORVO INC	11.79	98	10,915	情報技術
AFLAC INC	70.68	322	35,734	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	12.48	115	12,734	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	10	46	5,152	一般消費財・サービス
ADOBE SYSTEMS INC	43.22	1,115	123,464	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17.5	78	8,700	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	10.08	126	14,043	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	44.09	82	9,169	金融
GARMIN LTD	7.5	46	5,141	一般消費財・サービス
AETNA INC	29.32	551	61,037	ヘルスケア
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19.42	321	35,619	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	65.31	987	109,295	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	17.1	149	16,492	情報技術
WR BERKLEY CORP	6	45	4,999	金融
AUTOZONE INC	2.4	163	18,142	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	19.11	168	18,684	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	73.54	174	19,355	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	9	67	7,511	公益事業
CELANESE CORP-SERIES A	12.97	149	16,522	素材
DR HORTON INC	33.06	142	15,763	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4.5	28	3,200	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	109	12,172	ヘルスケア
AUTODESK INC	19.13	264	29,305	情報技術
MOODY'S CORP	14.9	262	29,013	金融
DEVON ENERGY CORP	48.68	203	22,472	エネルギー
ALBEMARLE CORP	8	74	8,293	素材
ATMOS ENERGY CORP	10.5	89	9,957	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	22	87	9,647	公益事業
CITIGROUP INC	223.28	1,477	163,498	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	36.87	515	57,057	情報技術

銘柄	2018年6月15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		
AMERICAN ELECTRIC POWER	44.53	287	31,848	公益事業
ALLEGHANY CORP	1.38	80	8,883	金融
DOMINO'S PIZZA INC	3	82	9,086	一般消費財・サービス
HESS CORP	28.96	176	19,542	エネルギー
DAVITA INC	10	71	7,862	ヘルスケア
DANAHER CORP	54.31	557	61,697	ヘルスケア
FORTIVE CORP	30.44	243	26,996	資本財・サービス
AVNET INC	11	44	4,891	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	53.14	395	43,829	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	12	28	3,117	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17.01	36	4,091	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45.84	207	22,952	生活必需品
BUNGE LTD	9.5	67	7,418	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	32.46	322	35,678	情報技術
APPLE INC	441.42	8,422	932,179	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.59	252	27,957	金融
BOEING CO/THE	47.47	1,720	190,414	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14.5	99	11,060	金融
BECTON DICKINSON AND CO	22.83	531	58,829	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	15	44	4,947	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	14	85	9,413	情報技術
CDK GLOBAL INC	11	72	8,018	情報技術
NISOURCE INC	40.26	96	10,689	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10.5	94	10,509	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	86.06	488	54,102	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	354.73	1,696	187,748	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	110.2	2,121	234,791	金融
ANSYS INC	7.2	127	14,098	情報技術
H&R BLOCK INC	16	38	4,209	一般消費財・サービス
BB&T CORP	69.55	364	40,367	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	140.41	753	83,344	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	297.28	3,211	355,450	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	22.75	281	31,137	金融
CIGNA CORP	20.45	358	39,684	ヘルスケア
LKQ CORP	33	109	12,107	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5.47	67	7,504	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26.52	140	15,539	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	26.5	119	13,180	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12	177	19,610	金融
DOLLAR GENERAL CORP	21.98	211	23,434	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	13.91	257	28,534	情報技術
CATERPILLAR INC	52.28	800	88,612	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	25	109	12,069	公益事業
MOSAIC CO/THE	30	88	9,788	素材
DELTA AIR LINES INC	16.5	90	10,025	資本財・サービス
CORNING INC	70.47	203	22,533	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	423.66	1,893	209,554	情報技術
MORGAN STANLEY	115.15	590	65,393	金融
WABCO HOLDINGS INC	3.2	39	4,355	資本財・サービス
MSCI INC	7.3	125	13,925	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.5	95	10,534	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	4	42	4,700	資本財・サービス
COTY INC-CL A	47.57	67	7,507	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17.34	91	10,175	情報技術
BROADCOM INC	36.09	968	107,234	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	3	34	3,790	ヘルスケア
ACUITY BRANDS INC	3.5	42	4,678	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7	74	8,294	ヘルスケア
ARAMARK	17	67	7,481	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14	43	4,834	素材
DTE ENERGY COMPANY	13.5	131	14,501	公益事業
CENTENE CORP	15.5	191	21,186	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9	93	10,340	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40.5	167	18,557	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17.97	118	13,122	金融
GARTNER INC	8	109	12,156	情報技術
SPLUNK INC	11	131	14,548	情報技術
AGCO CORP	5	30	3,413	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC	55.8	365	40,464	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	33.5	187	20,782	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	14	89	9,912	資本財・サービス
DEERE & CO	26.86	403	44,646	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	12	141	15,639	情報技術
TIME WARNER INC	68.88	680	75,298	一般消費財・サービス
VMWARE INC-CLASS A	5	75	8,314	情報技術
CHEMOURS CO/THE	14	69	7,713	素材
NASDAQ INC	8.5	80	8,915	金融
VAIL RESORTS INC	3.9	109	12,132	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年6月15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		
EAST WEST BANCORP INC	14.61	102	11,348	金融
TARGA RESOURCES CORP	20.29	98	10,896	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	4.5	64	7,146	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	95	10,618	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4.05	45	5,033	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	29.94	219	24,273	公益事業
COGNEX CORP	14	64	7,093	情報技術
TELEFLEX INC	4.85	137	15,253	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8.06	104	11,565	資本財・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12.25	101	11,257	ヘルスケア
IDEX CORP	7	100	11,130	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	68.51	433	48,005	生活必需品
ROLLINS INC	7	36	4,049	資本財・サービス
AMETEK INC	19.82	148	16,417	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	21.55	107	11,878	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10	41	4,627	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	10.6	118	13,100	資本財・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A	28.2	321	35,628	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	38.64	792	87,723	生活必需品
SCANA CORP	7	25	2,858	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4	62	6,884	金融
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2.4	110	12,230	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	28	63	6,975	金融
UGI CORP	20.9	102	11,392	公益事業
CUMMINS INC	13	184	20,415	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	65.65	510	56,465	情報技術
SABRE CORP	16	42	4,676	情報技術
CDW CORP/DE	13	108	12,063	情報技術
SIGNATURE BANK	3.5	44	4,883	金融
COSTAR GROUP INC	3.82	156	17,322	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	4.5	142	15,763	金融
AMERCO	0.7	24	2,727	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4.4	70	7,805	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	3.83	116	12,929	情報技術
HANESBRANDS INC	29	58	6,474	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	109	12,144	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23.13	191	21,230	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	22.45	67	7,521	情報技術
IPG PHOTONICS CORP	2.5	60	6,672	情報技術
COPART INC	17.78	103	11,429	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	9.79	113	12,563	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	10	65	7,248	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	6.5	238	26,350	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	5	172	19,046	資本財・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	25	78	8,724	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	171.69	291	32,209	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	26.89	285	31,550	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	46.08	108	12,041	エネルギー
T-MOBILE US INC	26	154	17,130	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	7	45	5,042	情報技術
COCA-COLA CO/THE	354.29	1,543	170,889	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	16	63	6,994	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	12.5	95	10,621	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	12.5	68	7,594	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	22	72	8,071	金融
CSX CORP	70.81	466	51,639	資本財・サービス
FLUOR CORP	12.9	63	6,980	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7.5	140	15,595	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	11.5	142	15,729	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	8	127	14,089	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	35.28	6,081	673,131	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	16	44	4,908	エネルギー
FLOWERVE CORP	9	37	4,137	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	19.45	294	32,626	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	368.52	3,017	334,011	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	8	43	4,807	情報技術
AES CORP	40	52	5,835	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	6.5	128	14,227	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	3.5	79	8,754	金融
EOG RESOURCES INC	50.99	599	66,328	エネルギー
EQT CORP	19	106	11,809	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	12.5	101	11,186	情報技術
ABIOMED INC	3.55	156	17,313	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	13.6	126	14,051	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25	165	18,347	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	321.29	382	42,281	一般消費財・サービス
MACY'S INC	22	82	9,145	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	11	28	3,104	一般消費財・サービス

銘柄	2018年6月15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		
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	71	7,875	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC-C	21.49	51	5,744	一般消費財・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	18.24	99	11,012	資本財・サービス
FORTINET INC	10.5	69	7,639	情報技術
MARKEL CORP	1.1	120	13,391	金融
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	8	20	2,277	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	40.5	643	71,191	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	114.5	201	22,278	素材
US BANCORP	142.81	727	80,501	金融
UNITED RENTALS INC	6	98	10,921	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	5.5	99	11,057	情報技術
FASTENAL CO	29.07	153	16,985	資本財・サービス
FISERV INC	35	267	29,607	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	733.08	999	110,671	資本財・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	14.01	79	8,747	ヘルスケア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	21.49	117	12,951	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	22.5	56	6,250	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	108.49	472	52,317	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	7	40	4,472	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	20.61	403	44,668	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	31.14	727	80,529	金融
ALPHABET INC-CL A	25.61	2,971	328,834	情報技術
ALPHABET INC-CL C	26.56	3,060	338,684	情報技術
OWENS CORNING	8	52	5,773	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	44.5	198	21,922	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	44.88	153	17,023	公益事業
GENUINE PARTS CO	12	112	12,494	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	33.55	170	18,848	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	58.5	180	19,968	金融
HARRIS CORP	9.82	147	16,297	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9.5	40	4,529	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	78.26	373	41,342	エネルギー
HOME DEPOT INC	100.09	1,998	221,193	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	7.8	74	8,266	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	107.45	165	18,338	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3.5	76	8,520	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	13.58	125	13,848	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	14	61	6,848	一般消費財・サービス
HUMANA INC	12.88	392	43,398	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	28.5	322	35,647	情報技術
HELMERICH & PAYNE	13.36	86	9,607	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	11	80	8,872	ヘルスケア
HP INC	141.5	336	37,273	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	132.5	209	23,200	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	11	51	5,671	一般消費財・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	11	80	8,882	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13.5	45	4,987	一般消費財・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	8.5	39	4,362	一般消費財・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	12	97	10,775	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	50.98	309	34,232	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	80.62	1,170	129,562	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	30.5	173	19,187	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	85	9,429	資本財・サービス
ZOETIS INC	41	361	40,001	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	20.44	187	20,792	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	17.5	113	12,576	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	90	10,048	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	15.72	69	7,699	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	51.08	146	16,259	一般消費財・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	20	152	16,900	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	28.5	79	8,775	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	9	93	10,334	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	229.84	2,813	311,395	ヘルスケア
ABBVIE INC	135.27	1,335	147,845	ヘルスケア
HOLOGIC INC	30.42	122	13,544	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	31.41	320	35,473	生活必需品
KROGER CO	71.6	187	20,730	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	15.2	171	19,032	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	22.88	710	78,652	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7.3	150	16,606	情報技術
L BRANDS INC	19.5	70	7,767	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	71.06	704	77,988	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	86.98	751	83,128	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	14.77	267	29,616	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	3	51	5,661	不動産
LOEWS CORP	25.5	126	14,001	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	18	122	13,557	金融
MCDONALD'S CORP	68.43	1,143	126,520	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年6月15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		
3M CO	52.52	1,069	118,368	資本財・サービス
FACEBOOK INC-A	208.18	4,097	453,477	情報技術
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	17.17	150	16,706	情報技術
MANPOWERGROUP INC	6.5	60	6,695	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	21.4	443	49,097	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5.4	124	13,758	素材
CONCHO RESOURCES INC	12	152	16,900	エネルギー
FIRST DATA CORP- CLASS A	38.5	83	9,208	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	19	69	7,688	電気通信サービス
PHILLIPS 66	38.47	444	49,199	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	45.61	146	16,234	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	39	122	13,566	一般消費財・サービス
MATTEL INC	36	64	7,140	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	24.29	205	22,703	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VGT SHRS	10.29	108	12,056	生活必需品
MYLAN NV	48.88	193	21,375	ヘルスケア
METLIFE INC	75.19	351	38,922	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	37.34	81	8,992	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	4.23	118	13,161	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13.49	62	6,956	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14.35	163	18,090	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.1	124	13,776	ヘルスケア
BAKER HUGHES A GE CO	37.84	127	14,105	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	11	196	21,785	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	5.36	24	2,685	金融
MERCK & CO. INC.	236.14	1,453	160,893	ヘルスケア
DOWDUPONT INC	203.58	1,392	154,075	素材
MASCO CORP	22	84	9,355	資本財・サービス
M & T BANK CORP	13.23	231	25,582	金融
MARSH & MCLENNAN COS	45.04	369	40,847	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	27.83	386	42,738	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	12	153	17,027	情報技術
SQUARE INC - A	27.91	178	19,733	情報技術
TRANSUNION	20.15	143	15,896	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP	25	60	6,643	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11	72	8,017	一般消費財・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	28.76	242	26,837	情報技術
NETAPP INC	23	178	19,728	情報技術
NIKE INC -CL B	108.66	811	89,837	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	25.53	391	43,365	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20.5	210	23,272	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10.5	103	11,441	金融
ALLY FINANCIAL INC	33	86	9,620	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	14.4	464	51,409	資本財・サービス
APTIV PLC	21	215	23,849	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	41.5	162	17,987	素材
MCKESSON CORP	17.69	265	29,368	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23.87	146	16,229	情報技術
XYLEM INC	13	93	10,320	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	136.09	1,100	121,779	生活必需品
NUCOR CORP	27	185	20,479	素材
WESTERN UNION CO	36	74	8,231	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	13	95	10,582	情報技術
NEWELL BRANDS INC	40.58	107	11,852	一般消費財・サービス
EVERGY INC	9	46	5,174	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	67.97	573	63,455	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	8	61	6,773	一般消費財・サービス
PAYCHEX INC	26.75	185	20,529	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7	197	21,839	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	164.46	932	103,207	生活必需品
P G & E CORP	41	163	18,101	公益事業
PFIZER INC	510.16	1,844	204,175	ヘルスケア
ALKERMES PLC	10.5	52	5,826	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	40.5	173	19,216	公益事業
STRYKER CORP	28.18	475	52,632	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	12.39	212	23,574	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13.53	259	28,669	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	4	51	5,724	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	216.56	1,645	182,139	生活必需品
EXELON CORP	78.54	322	35,701	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17.5	210	23,273	ヘルスケア
NVR INC	0.3	93	10,341	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	97.88	666	73,807	エネルギー
PEPSICO INC	120.83	1,270	140,595	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35.5	350	38,800	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13.5	107	11,920	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	51.65	840	93,043	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6	33	3,762	金融

銘柄	2018年6月15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		
PENTAIR PLC	15.75	68	7,631	資本財・サービス
QUALCOMM INC	125.36	745	82,499	情報技術
INVESCO LTD	37	100	11,142	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	5	66	7,387	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23	129	14,321	金融
RAYTHEON COMPANY	25.67	520	57,584	資本財・サービス
RED HAT INC	15.3	269	29,786	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	7.45	235	26,029	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	20.5	141	15,707	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	4.23	898	99,396	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	30.35	256	28,384	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	8.44	101	11,282	素材
RESMED INC	13.83	147	16,341	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	12	133	14,734	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	8	55	6,191	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	4	55	6,157	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	13.1	180	19,991	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	92.5	172	19,062	金融
CHEVRON CORP	166.61	2,107	233,289	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	31.03	186	20,675	公益事業
TESLA INC	11.94	427	47,273	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	54	115	12,766	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	12.18	173	19,181	資本財・サービス
SYNOPLYS INC	11	99	11,063	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	16.1	475	52,676	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	28	135	14,968	不動産
TWITTER INC	57	266	29,499	情報技術
SOUTHERN CO/THE	89.27	394	43,681	公益事業
SYSCO CORP	43.92	291	32,316	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	24.82	319	35,398	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	10	65	7,272	金融
STERICYCLE INC	5	32	3,553	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	23	112	12,476	素材
SCHLUMBERGER LTD	111.32	760	84,188	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10.5	56	6,254	資本財・サービス
AT&T INC	535.63	1,741	192,790	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	9	46	5,173	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	36.27	93	10,393	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7.61	305	33,792	素材
SEMPRA ENERGY	20.68	234	25,937	公益事業
TIFFANY & CO	10.86	147	16,307	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	23.49	138	15,360	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	85.51	980	108,573	情報技術
SALESFORCE.COM INC	60.07	831	92,022	情報技術
WESTROCK CO	23.21	140	15,541	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	83.88	292	32,391	資本財・サービス
ANDEAVOR	15.2	211	23,387	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	69.46	1,006	111,427	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	61	128	14,259	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	41.75	313	34,744	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	65.43	830	91,927	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	60.33	707	78,251	資本財・サービス
UNUM GROUP	19	73	8,165	金融
SPRINT CORP	41.14	22	2,486	電気通信サービス
ANTERO RESOURCES CORP	10	19	2,187	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	14.32	147	16,350	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	18	93	10,299	金融
AMEREN CORPORATION	18.5	104	11,542	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	82.66	2,110	233,596	ヘルスケア
VERISIGN INC	7.5	105	11,722	情報技術
VALERO ENERGY CORP	38.82	453	50,192	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	4.8	118	13,100	一般消費財・サービス
FNF GROUP	17.5	66	7,400	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6	68	7,609	ヘルスケア
ANTHEM INC	21.49	519	57,498	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	128.29	1,395	154,415	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	408.06	2,233	247,228	金融
WASTE MANAGEMENT INC	36.64	306	33,890	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	77.9	211	23,460	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10.5	78	8,637	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	5	77	8,603	一般消費財・サービス
WALMART INC	130.54	1,093	121,061	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	9	79	8,793	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15.5	178	19,708	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	7.17	126	13,986	一般消費財・サービス
XEROX CORP	19.88	55	6,103	情報技術
WABTEC CORP	11.05	112	12,475	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	56.03	529	58,640	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年6月15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		
WATERS CORP	6.5	130	14,407	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	3.5	25	2,828	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	28.49	495	54,851	ヘルスケア
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	73.2	474	52,556	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10.36	161	17,892	金融
WESTERN DIGITAL CORP	25.45	210	23,252	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	28.69	171	19,007	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42.5	221	24,563	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	155.17	2,094	231,851	情報技術
PPL CORP	59	159	17,677	公益事業
PULTEGROUP INC	19	58	6,476	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	20.12	209	23,150	素材
NORTHERN TRUST CORP	20.62	220	24,408	金融
NVIDIA CORP	50.59	1,350	149,450	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	6	97	10,775	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41.75	592	65,542	金融
QURATE RETAIL INC	42.88	91	10,180	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12	51	5,749	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	24.5	173	19,250	生活必需品
NETFLIX INC	37.86	1,487	164,626	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	35.75	774	85,684	ヘルスケア
TORCHMARK CORP	12.15	102	11,322	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13	130	14,397	金融
TEXTRON INC	22.1	149	16,508	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	88.5	394	43,666	一般消費財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	32	142	15,732	一般消費財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	29	46	5,141	一般消費財・サービス
OGE ENERGY CORP	12	41	4,590	公益事業
OMNICOM GROUP	18.5	139	15,432	一般消費財・サービス
ORACLE CORP	263.57	1,209	133,899	情報技術
MASTERCARD INC - A	80.11	1,596	176,719	情報技術
ONEOK INC	37.36	259	28,672	エネルギー
CENTURYLINK INC	74.49	134	14,848	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	9	254	28,211	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	25.24	210	23,292	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8	97	10,788	情報技術
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4	90	10,026	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	17.75	118	13,107	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	37.5	129	14,348	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	850.9	2,510	277,823	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14.97	134	14,908	ヘルスケア
NORDSTROM INC	8	39	4,415	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	65.84	656	72,696	金融
ANALOG DEVICES INC	33.36	339	37,550	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	95.45	155	17,167	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23.94	143	15,895	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	74.69	409	45,301	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	51.05	362	40,139	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15.69	159	17,707	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13.68	155	17,185	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	12	35	3,878	エネルギー
AVERY DENNISON CORP	6.5	69	7,645	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	53.53	420	46,538	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	56.56	412	45,635	資本財・サービス
AON PLC	22.96	321	35,630	金融
AMGEN INC	57.98	1,077	119,225	ヘルスケア
TAPESTRY INC	25.5	116	12,850	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	34.89	276	30,614	資本財・サービス
CELGENE CORP	70.24	550	60,941	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15.06	349	38,700	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	91.64	455	50,399	情報技術
CIT GROUP INC	9	46	5,114	金融
CIMAREX ENERGY CO	8	69	7,663	エネルギー
CME GROUP INC	30.41	513	56,834	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33.89	142	15,813	エネルギー
ECOLAB INC	23.64	343	38,043	素材
EQUIFAX INC	8.5	106	11,791	資本財・サービス
GAP INC/THE	28.2	88	9,778	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	110.64	787	87,127	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14.76	178	19,706	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	22	79	8,792	生活必需品
STATE STREET CORP	30	294	32,626	金融
SUNTRUST BANKS INC	39.22	270	29,904	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	105.06	594	65,826	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	45.41	342	37,900	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	13	47	5,253	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	8	35	3,981	素材
CARDINAL HEALTH INC	24.5	133	14,811	ヘルスケア

銘柄	2018年6月15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		
FEDEX CORP	22.83	601	66,576	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40.54	390	43,200	金融
FMC CORP	11.42	103	11,413	素材
FLEX LTD	45	63	6,977	情報技術
CERNER CORP	23.68	144	16,008	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6.5	80	8,957	素材
CITRIX SYSTEMS INC	13.5	144	15,960	情報技術
INTEL CORP	401.99	2,232	247,109	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28	66	7,307	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	28.5	151	16,743	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	25	372	41,197	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153	112	12,497	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC	13.07	379	41,974	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	63	7,072	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	9.27	459	50,840	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	12.36	123	13,671	情報技術
SNAP-ON INC	5	79	8,825	資本財・サービス
CARMAX INC	19.9	145	16,126	一般消費財・サービス
COMERICA INC	14.76	140	15,548	金融
INGREDION INC	5.3	59	6,636	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	60.64	445	49,303	公益事業
TARGET CORP	42	324	35,896	一般消費財・サービス
DOVER CORP	12	91	10,101	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	4	126	14,051	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11.16	72	8,071	資本財・サービス
CINTAS CORP	7.63	146	16,177	資本財・サービス
CA INC	22	81	9,023	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	34.42	131	14,552	生活必需品
CLOROX COMPANY	12.78	163	18,089	生活必需品
ENTERGY CORP	16	122	13,584	公益事業
MICROSOFT CORP	626.72	6,356	703,503	情報技術
INCYTE CORP	14.47	106	11,793	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	87.67	605	67,069	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	116.31	1,006	111,443	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	97.83	578	64,079	情報技術
BLACKROCK INC	10.57	553	61,227	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	29	75	8,403	公益事業
HASBRO INC	10	91	10,139	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	26.2	174	19,312	生活必需品
KEYCORP	87.73	180	19,934	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	7.5	81	9,019	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	133.02	537	59,479	生活必需品
KOHL'S CORP	16.5	120	13,382	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	3.5	82	9,109	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	48.28	55	6,166	金融
APACHE CORP	36.73	157	17,435	エネルギー
CHUBB LTD	39.01	507	56,172	金融
ARROW ELECTRONICS INC	10	79	8,754	情報技術
ALLSTATE CORP	29.1	270	29,888	金融
EBAY INC	90.53	353	39,077	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC	96.73	828	91,654	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	12.83	138	15,326	素材
XILINX INC	22	154	17,149	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	48.32	397	43,982	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP-A	15	51	5,657	一般消費財・サービス
ZIONS BANCORPORATION	19	105	11,660	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	20.44	319	35,375	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	12	46	5,186	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	22	77	8,619	情報技術
LENNAR CORP-A	22.6	119	13,274	一般消費財・サービス
LEAR CORP	6	121	13,460	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	23	149	16,505	金融
PROGRESSIVE CORP	50.67	313	34,708	金融
PRAXAIR INC	26.34	425	47,096	素材
PACCAR INC	27.8	177	19,618	資本財・サービス
PVH CORP	5.5	88	9,754	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	18.99	580	64,248	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	7.42	167	18,566	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	124.84	711	78,786	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC	9	67	7,453	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	24	129	14,341	公益事業
INTUIT INC	20.97	438	48,526	情報技術
BORGWARNER INC	15.5	75	8,375	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	23	168	18,664	一般消費財・サービス
BALL CORP	28.92	106	11,804	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	115.5	375	41,559	ヘルスケア
XL GROUP LTD	18.5	103	11,507	金融
ELECTRONIC ARTS INC	25.74	371	41,135	情報技術

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年6月15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	
VULCAN MATERIALS CO	10.5	138	15,323	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	23.03	356	39,506	ヘルスケア
VF CORP	32.04	269	29,798	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	28.41	156	17,332	一般消費財・サービス
VIACOM INC-CLASS B	30.71	88	9,826	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	4.8	102	11,374	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10.03	123	13,688	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	38.14	244	27,100	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	406.32	1,374	152,093	一般消費財・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	21	77	8,599	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	22	138	15,276	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	56	49	5,485	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	110	81	9,009	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	26,316.24 600銘柄	209,775 <64.3%>	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)				
IMPERIAL OIL LTD	23	99	8,371	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1.5	157	13,281	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	24.38	63	5,394	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	21.21	167	14,092	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	42	122	10,328	素材
INTACT FINANCIAL CORP	10	95	8,019	金融
BCE INC	9	48	4,121	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	16	146	12,317	素材
SUNCOR ENERGY INC	129.12	673	56,773	エネルギー
METRO INC	16	70	5,928	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	33	210	17,746	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	99	752	63,433	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	38	437	36,916	金融
TORONTO-DOMINION BANK	151	1,150	97,031	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	17	56	4,781	金融
ROYAL BANK OF CANADA	120	1,198	101,044	金融
TOURMALINE OIL CORP	13	31	2,644	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	14	64	5,413	エネルギー
TRANSCANADA CORP	76	414	34,948	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	37.71	170	14,389	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	192	93	7,917	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	83	143	12,073	素材
CAE INC	23	63	5,331	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	20.2	108	9,152	金融
EMPIRE CO LTD 'A'	18	44	3,728	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6	51	4,358	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10	66	5,567	素材
LINAMAR CORP	6	38	3,224	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	11	16	1,373	エネルギー
HYDRO ONE LTD	15	29	2,467	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	14.89	97	8,259	生活必需品
WSP GLOBAL INC	12	88	7,471	資本財・サービス
EMERA INC	12	48	4,071	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	31	2,650	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	30	185	15,670	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	18	109	9,253	素材
KINROSS GOLD CORP	105.34	52	4,415	素材
BANK OF MONTREAL	51	519	43,799	金融
POWER CORP OF CANADA	31	94	8,007	金融
METHANEX CORP	6	53	4,532	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	8	176	14,856	情報技術
NUTRIEN LTD	51.27	360	30,399	素材
CAMECO CORP	28	44	3,742	エネルギー
TELUS CORP	3	13	1,169	電気通信サービス
POWER FINANCIAL CORP	20	64	5,440	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44	164	13,888	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5	86	7,297	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	80	30	2,529	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	91	382	32,223	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2	152	12,820	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	31	265	22,414	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	7	72	6,134	生活必需品
BLACKBERRY LTD	64	102	8,635	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	52	284	23,995	金融
ENBRIDGE INC	143	610	51,480	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	66	363	30,628	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	160	397	33,556	金融
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	20	70	5,914	ヘルスケア
GOLDCORP INC	63	118	9,956	素材
ENCANA CORP	69	114	9,659	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12	305	25,746	資本財・サービス
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	11	57	4,870	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	14	52	4,468	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	64	700	59,060	資本財・サービス

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
CGI GROUP INC - CLASS A	19	154	13,042	情報技術
HUSKY ENERGY INC	30.12	59	5,021	エネルギー
ONEX CORPORATION	7	64	5,473	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	39	107	9,097	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	25	84	7,155	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	19	113	9,551	資本財・サービス
IGM FINANCIAL INC	3	11	1,005	金融
OPEN TEXT CORP	27	127	10,724	情報技術
CI FINANCIAL CORP	20	49	4,209	金融
SAPUTO INC	13	56	4,772	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	138	11,661	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	30	164	13,861	生活必需品
FORTIS INC	42	170	14,379	公益事業
LUNDIN MINING CORP	66	55	4,647	素材
CRESCENT POINT ENERGY CORP	25	24	2,061	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	80	99	8,352	エネルギー
DOLLARAMA INC	9	136	11,514	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	8	31	2,645	公益事業
ALTAGAS LTD	8	20	1,764	エネルギー
FIRST CAPITAL REALTY INC	20	42	3,555	不動産
KEYERA CORP	22	79	6,693	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	48	117	9,941	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	28	36	3,119	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,324.74 87銘柄	15,005 1,265,448	<3.5%>
(オーストラリア)	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD	160	36	3,023	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	66	5,462	金融
BHP BILLITON LIMITED	256.32	855	70,612	素材
SOUTH32 LTD	362.13	137	11,386	素材
ALUMINA LTD	121	33	2,736	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	77.28	260	21,506	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	105	48	4,029	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	36	36	3,021	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	223.99	581	47,970	金融
WESTPAC BANKING CORP	268.2	732	60,427	金融
SANTOS LTD	182.7	106	8,775	エネルギー
AUSNET SERVICES	285	44	3,657	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	248.74	651	53,784	金融
RIO TINTO LTD	39.49	334	27,578	素材
ORIGIN ENERGY LTD	120.5	116	9,646	エネルギー
AMCOR LIMITED	109.96	151	12,514	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	153.1	66	5,458	資本財・サービス
OIL SEARCH LTD	154.18	129	10,663	エネルギー
SEEK LTD	26	55	4,542	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	55.92	98	8,099	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	58.04	118	9,819	素材
INCITEC PIVOT LTD	204	70	5,808	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	145	978	80,716	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	20	60	5,004	エネルギー
ORICA LTD	20	34	2,870	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	150.22	139	11,529	金融
CIMIC GROUP LTD	10	40	3,339	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	117.6	340	28,126	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	26	23	1,903	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	173.52	79	6,573	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	30	39	3,280	一般消費財・サービス
TELSTRA CORP LTD	351.14	101	8,404	電気通信サービス
AMP LTD	249.35	90	7,470	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	32	69	5,717	素材
MACQUARIE GROUP LTD	25.42	288	23,800	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	40.35	119	9,857	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	30	29	2,453	金融
CSL LTD	37.29	696	57,485	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	95.67	449	37,109	生活必需品
COCHLEAR LTD	4.44	84	6,954	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	32.12	58	4,864	素材
SUNCORP GROUP LTD	99.38	137	11,375	金融
BORAL LTD	86	54	4,499	素材
ASX LTD	13	80	6,646	金融
COMPUTERSHARE LTD	37	66	5,456	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	175.18	139	11,479	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	25	59	4,931	ヘルスケア
CHALLENGER LTD	63	77	6,431	金融
AGL ENERGY LTD	70.39	150	12,455	公益事業
BRAMBLES LTD	113.37	102	8,448	資本財・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	8	50	4,130	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9	52	4,291	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
REA GROUP LTD	6.08	54	4,521	情報技術
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	6.21	31	2,635	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	5,777.52	9,515	785,293	
	銘柄数 < 比率 >	54 銘柄	< 2.2% >	
(香港)		千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	145	801	11,306	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	220	1,426	20,116	一般消費財・サービス
MTR CORP	75	327	4,610	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	120	1,478	20,845	不動産
SINO LAND CO	340	454	6,404	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	225.52	1,991	28,077	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	80	204	2,876	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	35	290	4,096	不動産
CLP HOLDINGS LTD	135	1,096	15,465	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	105.14	463	6,530	不動産
HANG LUNG GROUP LTD	80	189	2,667	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	793.05	1,178	16,616	公益事業
HANG SENG BANK LTD	64	1,266	17,858	金融
WHEELOCK & CO LTD	60	345	4,877	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	580	687	9,699	不動産
WH GROUP LTD	915	636	8,979	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	100	2,556	36,039	金融
MINTH GROUP LTD	60	222	3,142	一般消費財・サービス
LI & FUNG LTD	700	210	2,970	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	120	207	2,927	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20	211	2,986	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	80	186	2,622	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	150	218	3,083	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	75	321	4,531	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	86	275	3,880	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	60	268	3,785	不動産
SJM HOLDINGS LTD	100	103	1,457	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	80	246	3,479	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	230.52	1,513	21,338	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	325	4,583	公益事業
PCCW LTD	600	269	3,798	電気通信サービス
AIA GROUP LTD	1,076	7,548	106,428	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140	832	11,735	不動産
SANDS CHINA LTD	230	1,040	14,674	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	40	66	940	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	120	567	7,994	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	140	296	4,175	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	290	1,154	16,274	金融
WYNN MACAU LTD	168	475	6,703	一般消費財・サービス
香港ドル通貨計	8,693.23	31,956	450,584	
	銘柄数 < 比率 >	39 銘柄	< 1.2% >	
(シンガポール)		千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	108	291	23,925	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	145	400	32,908	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	71	79	6,530	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	173	125	10,295	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	52	39	3,278	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	58	4,791	不動産
CAPITALAND LTD	190	64	5,294	不動産
YANGZHIJIANG SHIPBUILDING	270	26	2,141	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	120	31	2,594	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9	29	2,452	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	258	312	25,724	金融
GENTING SINGAPORE LTD	450	54	4,512	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	32	64	5,289	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	654	208	17,149	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	48	3,998	資本財・サービス
SEBACORP INDUSTRIES LTD	40	11	920	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	90	2	236	生活必需品
SATS LTD	77	38	3,177	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	69	49	4,089	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	100	23	1,907	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	51	4,259	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	3,259	2,013	165,478	
	銘柄数 < 比率 >	21 銘柄	< 0.5% >	
(ニュージーランド)		千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	150	47	3,634	公益事業
A2 MILK CO LTD	70	80	6,192	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	64	4,928	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81	56	4,318	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	23.26	15	1,207	素材

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	百株 37	千ニュージーランド・ドル 55	千円 4,272	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	53	4,079	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 >	574.05 7銘柄	372 <0.1%>	
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT	50	19	2,807	一般消費財・サービス
TUI AG-DI	48.02	84	12,426	一般消費財・サービス
BP PLC	1,739.3	1,018	149,352	エネルギー
UNILEVER PLC	101.99	411	60,332	生活必需品
BARCLAYS PLC	1,505.91	302	44,303	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	140.34	123	18,170	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	105	32	4,727	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	10.12	60	8,822	素材
PRUDENTIAL PLC	225.06	419	61,542	金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	345.42	91	13,353	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	67	9,856	素材
BAE SYSTEMS PLC	293.37	190	28,001	資本財・サービス
AVIVA PLC	327.89	169	24,861	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	420.6	664	97,474	ヘルスケア
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	31.33	42	6,283	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC	400	96	14,108	資本財・サービス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	29	16	2,399	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	133.52	56	8,265	情報技術
DCC PLC	9.38	68	9,973	資本財・サービス
GVC HOLDINGS PLC	41.61	43	6,316	一般消費財・サービス
CONVATEC GROUP PLC	65.81	14	2,199	ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC	100.76	50	7,465	資本財・サービス
NMC HEALTH PLC	9.75	35	5,267	ヘルスケア
RELX PLC	83.81	134	19,783	資本財・サービス
DIAGEO PLC	208.95	579	84,992	生活必需品
RIO TINTO PLC	105.82	465	68,317	素材
STANDARD CHARTERED PLC	297.45	217	31,884	金融
TESCO PLC	887.48	221	32,513	生活必需品
FRESNILLO PLC	24	28	4,244	素材
SMITH & NEPHEW PLC	83.29	113	16,643	ヘルスケア
GLENCORE PLC	1,067.03	425	62,361	素材
WOOD GROUP (JOHN) PLC	54.66	35	5,146	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15	31	4,593	金融
SMITHS GROUP PLC	40.8	73	10,776	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	6	5	753	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	109.63	39	5,736	金融
PEARSON PLC	82.71	73	10,713	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	176.31	55	8,137	生活必需品
NEXT PLC	11.59	71	10,528	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	60	8,892	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	17.85	74	10,919	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	31.59	74	10,887	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	2,227.53	418	61,437	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	8.03	39	5,842	素材
KINGFISHER PLC	172.29	54	7,946	一般消費財・サービス
WPP PLC	99.21	122	17,896	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	64	9,505	公益事業
SEVERN TRENT PLC	13	24	3,584	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	58.55	360	52,809	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	60	8,883	金融
SCHROEDERS PLC	12.27	40	5,895	金融
SSE PLC	82.82	112	16,519	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	13	26	3,946	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	69	10,194	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	104.35	568	83,376	ヘルスケア
FERGUSON PLC	19.89	121	17,875	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	496.81	135	19,905	金融
3I GROUP PLC	84.39	82	12,124	金融
SKY PLC	86.77	117	17,179	一般消費財・サービス
ASHTREAD GROUP PLC	39	92	13,635	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	97.25	66	9,704	情報技術
NATIONAL GRID PLC	303.25	253	37,105	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,963.72	376	55,215	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	63.8	41	6,156	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	82.23	214	31,452	生活必需品
CENTRICA PLC	380.02	58	8,541	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7	29	4,310	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	192.39	718	105,372	生活必需品
BHP BILLITON PLC	178.2	311	45,704	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	29.6	81	11,942	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	1,669.22	1,226	179,835	金融
SHIRE PLC	82.23	334	49,077	ヘルスケア
OLD MUTUAL PLC	414.79	94	13,803	金融
ANGLO AMERICAN PLC	107.45	192	28,261	素材
MONDI PLC	34	70	10,406	素材

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2018年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
WM MORRISON SUPERMARKETS	145	35	5,235	生活必需品
CARNIVAL PLC	13.83	66	9,683	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	16.44	29	4,330	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	142.39	229	33,725	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	25.69	70	10,274	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	656.24	140	20,605	電気通信サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	12	31	4,628	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	33	71	10,468	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	13.72	67	9,948	一般消費財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC	17	24	3,569	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	15.92	92	13,612	資本財・サービス
ITV PLC	275.87	48	7,066	一般消費財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27.35	122	18,010	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	402.7	1,050	153,998	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	323.53	876	128,610	エネルギー
MEGGITT PLC	99.25	49	7,301	資本財・サービス
G4S PLC	113.2	31	4,640	資本財・サービス
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	29	4,393	金融
INVESTEC PLC	46	26	3,852	金融
ANTOFAGASTA PLC	34.6	36	5,404	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	204.57	72	10,596	金融
EXPERIAN PLC	75.55	142	20,852	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 >	25,865.65 97銘柄	16,789 <6.8%>	
	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
(イスラエル)				
AZRIELI GROUP LTD	5.3	97	2,992	不動産
FRUTAROM	4.18	147	4,507	素材
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	50	20	612	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD	110.96	197	6,047	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	3	133	4,082	資本財・サービス
BANK HAPOLIM BM	79	197	6,032	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	114	253	7,752	金融
NICE LTD	8	317	9,724	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 >	374.44 8銘柄	1,363 41,753 <0.1%>	
	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)				
DUFFRY AG-REG	1.89	26	2,927	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	324.02	510	56,641	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.5	32	3,643	素材
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	106	11,836	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	58.77	1,241	137,741	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	3.89	35	3,896	金融
SIKA AG-REG	11.4	166	18,499	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	75	8,385	生活必需品
ABB LTD-REG	146.76	342	38,043	資本財・サービス
SWISS RE AG	25	222	24,690	金融
NESTLE SA-REG	256.66	1,915	212,433	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1.63	121	13,433	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3	66	7,387	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	215.08	336	37,323	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	21.98	134	14,940	金融
SGS SA-REG	0.46	122	13,597	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1.53	33	3,696	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	3.69	60	6,665	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	5.08	78	8,694	情報技術
SWATCH GROUP AG/THE-BR	2.67	132	14,751	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	11.63	349	38,751	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	3.2	47	5,313	金融
CLARIANT AG-REG	15.68	38	4,311	素材
NOVARTIS AG-REG	186.7	1,409	156,351	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.2	36	4,024	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	44.47	411	45,646	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	2.76	123	13,653	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG	3.34	147	16,367	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	0.68	153	17,046	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1.11	85	9,461	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	5.63	97	10,865	ヘルスケア
LONZA GROUP AG-REG	5.42	149	16,532	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	40	4,517	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	38.01	198	22,016	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2.31	81	9,031	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4.95	76	8,436	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	87	9,700	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.1	63	7,032	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,441.71 38銘柄	9,360 1,038,291 <2.9%>	
	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)				
NOVO NORDISK A/S-B	165.16	4,721	81,075	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	72.36	1,585	27,221	金融

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
ISS A/S	13.2	293	5,040	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.3	278	4,777	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	5	229	3,943	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18.57	769	13,206	資本財・サービス
CARLSBERG AS-B	8.06	596	10,235	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	18.02	591	10,151	素材
COLOPLAST-B	10.52	671	11,534	ヘルスケア
DSV A/S	16.5	894	15,360	資本財・サービス
WILLIAM DEMANT HOLDING	13.14	339	5,829	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	655	11,255	資本財・サービス
TRYG A/S	17	256	4,395	金融
PANDORA A/S	7.5	366	6,291	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	7.5	489	8,398	素材
GENMAB A/S	4.33	427	7,343	ヘルスケア
ORSTED A/S	15.33	574	9,867	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	393.15 17銘柄	13,740	235,931 <0.7%>
	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)				
NORSK HYDRO ASA	130.5	692	9,424	素材
DNB ASA	85.45	1,355	18,431	金融
ORKLA ASA	70	512	6,964	生活必需品
TELENOR ASA	62.5	1,066	14,509	電気通信サービス
EQUINOR ASA	91.44	2,000	27,209	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	14.5	502	6,829	素材
MARINE HARVEST	23.5	402	5,474	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	258	3,519	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	17	417	5,675	一般消費財・サービス
AKER BP ASA	13.06	397	5,410	エネルギー
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	527.95 10銘柄	7,606	103,448 <0.3%>
	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)				
ICA GRUPPEN AB	7	191	2,424	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	263.83	1,798	22,736	情報技術
VOLVO AB-B SHS	145.68	2,183	27,593	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	7.77	427	5,401	電気通信サービス
SKF AB-B SHARES	40	689	8,711	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	26	568	7,180	一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB	265.29	2,271	28,710	金融
SWEDISH MATCH AB	12	509	6,435	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	32.58	378	4,779	電気通信サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	131	1,088	13,753	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	125.26	1,238	15,655	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	90.75	1,722	21,771	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	90.39	1,266	16,002	一般消費財・サービス
SKANSKA AB-B SHS	37.09	594	7,512	資本財・サービス
SANDVIK AB	101.22	1,585	20,035	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	33.82	1,263	15,975	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	69.82	1,947	24,618	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	25	363	4,594	資本財・サービス
TELIA CO AB	241.07	1,035	13,084	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB	20	449	5,675	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	25	634	8,013	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	84.01	1,605	20,287	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	270	3,422	金融
LUNDIN PETROLEUM AB	19	539	6,815	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	50.5	1,087	13,749	生活必需品
BOLIDEN AB	31.71	968	12,246	素材
EPIROC AB-A	69.82	585	7,399	その他
EPIROC AB-B	25	201	2,545	その他
HUSQVARNA AB-B SHS	24	211	2,668	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B	15	475	6,012	金融
HEXAGON AB-B SHS	24	1,235	15,616	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	240	3,036	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,156.09 32銘柄	29,625	374,468 <1.0%>
	百株	千ユーロ	千円	
(ユーロ (アイルランド))				
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19.95	69	8,859	素材
AIB GROUP PLC	90	44	5,709	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC	102.34	72	9,227	金融
KERRY GROUP PLC-A	12.66	113	14,467	生活必需品
CRH PLC	65	212	27,118	素材
PADDY POWER BETFAIR PLC	8.89	87	11,142	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	298.84 6銘柄	598	76,525 <0.2%>
	百株	千ユーロ	千円	
(ユーロ (オランダ))				
QIAGEN N. V.	25.21	81	10,385	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	81.13	299	38,346	ヘルスケア
NN GROUP NV	31	114	14,626	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2018年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
UNILEVER NV-CVA	127.32	594	75,982	生活必需品
HEINEKEN NV	22.15	194	24,935	生活必需品
RELX NV	82	149	19,155	資本財・サービス
AEGON NV	143.61	77	9,973	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	106.52	217	27,840	生活必需品
AKZO NOBEL	21.18	161	20,685	素材
KONINKLIJKE DSM NV	19.38	174	22,352	素材
WOLTERS KLUWER	23.76	114	14,635	資本財・サービス
ING GROEP NV	308.53	392	50,202	金融
KONINKLIJKE KPN NV	360	86	11,101	電気通信サービス
ASML HOLDING NV	32.31	599	76,698	情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA	34.53	79	10,166	金融
VOPAK	6.3	26	3,360	エネルギー
RANDSTAD NV	7.5	40	5,128	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	11	93	11,958	生活必需品
AIRBUS SE	47.04	491	62,907	資本財・サービス
EXOR NV	10.88	67	8,602	金融
CNH INDUSTRIAL NV	73.53	74	9,522	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	107.87	196	25,162	一般消費財・サービス
FERRARI NV	11.3	143	18,383	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,694.05 23銘柄	4,473 <1.6%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ベルギー)				
UCB SA	11.1	73	9,426	ヘルスケア
KBC GROUP NV	22.11	148	18,929	金融
COLRUYT SA	3.5	16	2,057	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9	84	10,808	金融
SOLVAY SA	8.73	98	12,661	素材
UMICORE	16	81	10,436	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60.89	511	65,441	生活必需品
AGEAS	16.54	73	9,344	金融
PROXIMUS	22.69	49	6,317	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	4.62	19	2,448	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	175.18 10銘柄	1,156 <0.4%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ルクセンブルグ)				
RTL GROUP	3.5	22	2,934	一般消費財・サービス
ARCELORMITTAL	53.27	154	19,789	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	1.31	54	7,020	ヘルスケア
SES	44.02	68	8,785	一般消費財・サービス
TENARIS SA	47	74	9,479	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	149.1 5銘柄	375 <0.1%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フランス)				
JCDECAUX SA	8.45	23	3,019	一般消費財・サービス
TOTAL SA	199.22	1,053	134,688	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	14.28	157	20,181	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	34.38	385	49,292	素材
KERING	6.12	314	40,280	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42.86	324	41,497	資本財・サービス
BOUYGUES SA	18.92	73	9,406	資本財・サービス
BNP PARIBAS	95.82	525	67,208	金融
PEUGEOT SA	45.73	97	12,469	一般消費財・サービス
NATIXIS	76.74	49	6,271	金融
THALES SA	9.18	101	12,997	資本財・サービス
DANONE	49.32	320	40,995	生活必需品
CARREFOUR SA	51.56	80	10,241	生活必需品
SUEZ	29.5	34	4,357	公益事業
VIVENDI	88.01	192	24,651	一般消費財・サービス
L'OREAL	20.56	434	55,511	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	40.13	166	21,302	資本財・サービス
LEGRAND SA	22.5	146	18,693	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	2	6	877	生活必需品
PERNOD RICARD SA	18.08	261	33,507	生活必需品
SOCIETE BIC SA	1.5	11	1,532	資本財・サービス
EURAZEO SA	5.34	35	4,586	金融
REXEL SA	38.7	51	6,612	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA	61.29	229	29,364	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	23.11	699	89,426	一般消費財・サービス
ACCOR SA	18.5	82	10,567	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	16.45	194	24,826	情報技術
VALEO SA	19.65	104	13,405	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	18.06	107	13,716	一般消費財・サービス
BUREAU VERITAS SA	32.27	75	9,649	資本財・サービス
EIFFAGE	7.5	72	9,243	資本財・サービス
SODEXO SA	6.69	57	7,334	一般消費財・サービス
IPSEN	2.76	37	4,839	ヘルスケア
INGENICO GROUP	4.99	38	4,881	情報技術
AMUNDI SA	4.37	27	3,537	金融

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
TELEPERFORMANCE	5	69	8,940	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	5	49	6,378	情報技術
FAURECIA	5.6	40	5,158	一般消費財・サービス
SEB SA	1.97	30	3,847	一般消費財・サービス
ESSILOR INTERNATIONAL	14.86	180	23,025	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA	0.22	37	4,794	資本財・サービス
AXA SA	157.75	344	44,054	金融
EDENRED	19.13	52	6,711	資本財・サービス
RENAULT SA	16.5	139	17,902	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	2.68	147	18,900	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	2.53	32	4,093	生活必需品
ATOS SE	9.46	116	14,912	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA	11.49	142	18,215	情報技術
WENDEL	2.01	25	3,223	金融
ORANGE	174.04	254	32,588	電気通信サービス
ALSTOM	13.1	52	6,745	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	13.49	26	3,411	金融
SANOFI	92.52	622	79,673	ヘルスケア
VINCI SA	39.22	336	43,039	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	38.63	75	9,639	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	99.04	119	15,263	金融
BIOMERIEUX	4.57	37	4,787	ヘルスケア
ENGIE	144.44	200	25,669	公益事業
IMERYS SA	3.4	24	3,104	素材
EDF	67.6	78	9,986	公益事業
SAFRAN SA	25.92	269	34,527	資本財・サービス
ILIAD SA	2.19	31	3,976	電気通信サービス
ARKEMA	8.38	87	11,136	素材
ADP	3.5	68	8,711	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	14	24	3,169	一般消費財・サービス
SCOR SE	12.97	41	5,361	金融
GETLINK	39.4	48	6,142	資本財・サービス
BOLLORE	73	30	3,891	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,258.15 68銘柄	10,414 <3.7%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ドイツ)				
BAYER AG-REG	68.61	691	88,454	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	18	55	7,132	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	156.95	151	19,385	金融
COMMERZBANK AG	96.89	90	11,521	金融
VOLKSWAGEN AG	4.2	68	8,756	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	13.72	224	28,662	一般消費財・サービス
MAN SE	1	9	1,191	資本財・サービス
SIEMENS AG-REG	60.87	734	93,968	資本財・サービス
E.ON SE	162.7	150	19,294	公益事業
UNIPER SE	13.8	35	4,514	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	29.21	251	32,230	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	13	41	5,325	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG	6.45	33	4,281	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	9	198	25,381	一般消費財・サービス
BASF SE	73.57	647	82,870	素材
K+S AG-REG	14	32	4,104	素材
ALLIANZ SE-REG	35.81	655	83,843	金融
THYSSENKRUPP AG	40.3	95	12,210	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	18.57	204	26,149	生活必需品
RWE AG	53.09	106	13,621	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17	40	5,183	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	5.6	47	6,088	資本財・サービス
BRENNTAG AG	14.36	72	9,264	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	37.09	263	33,652	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	55	7,123	情報技術
HOCHTIEF AG	1.66	26	3,401	資本財・サービス
SAP SE	78.08	814	104,158	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12.14	225	28,818	金融
SCHAEFFLER AG	21.02	27	3,496	一般消費財・サービス
ZALANDO SE	7	33	4,263	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	12.3	95	12,226	素材
KION GROUP AG	6	43	5,565	資本財・サービス
WIRECARD AG	10	156	19,990	情報技術
COVESTRO AG	19.45	150	19,304	素材
INNOGY SE	15	55	7,060	公益事業
SARTORIUS AG-VORZUG	3.05	40	5,188	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	12.65	79	10,212	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO AG	10.56	43	5,537	情報技術
METRO AG	15	17	2,187	生活必需品
1&1 DRILLISCH AG	5	32	4,121	電気通信サービス
LINDE AG - TENDER	16.27	340	43,533	素材
SIEMENS HEALTHINEERS AG	15	53	6,884	ヘルスケア
BEIERSDORF AG	8.15	80	10,357	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF	7	32	4,154	素材

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
MERCK KGAA	11.49	96	12,364	ヘルスケア
ADIDAS AG	15.92	316	40,468	一般消費財・サービス
PUMA SE	0.51	25	3,294	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	6.5	63	8,176	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	289.91	401	51,355	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	17.66	156	19,985	ヘルスケア
INFINEON TECHNOLOGIES AG	80.1	506	64,736	一般消費財・サービス
HANNOVER RUECK SE	97.73	249	31,861	情報技術
DEUTSCHE POST AG-REG	6.44	72	9,216	金融
DEUTSCHE BOERSE AG	75.48	229	29,309	資本財・サービス
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	18.97	220	28,241	金融
LANXESS AG	15.6	37	4,838	一般消費財・サービス
MTU AERO ENGINES AG	6	43	5,545	素材
AXEL SPRINGER SE	4	66	8,523	資本財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	4.7	28	3,702	一般消費財・サービス
SYMRISE AG	32.85	135	17,339	不動産
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	14.36	107	13,800	素材
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	62.4	22	2,930	電気通信サービス
HUGO BOSS AG -ORD	2.5	18	2,380	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	8.11	64	8,300	一般消費財・サービス
	44.35	184	23,540	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,064.29 65銘柄	10,356 1,324,584	<3.7%>
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ポルトガル)				
JERONIMO MARTINS	29	38	4,959	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	151	51	6,566	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	36.09	58	7,468	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	216.09 3銘柄	148 18,993	<0.1%>
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (スペイン)				
TELEFONICA SA	405.69	306	39,170	電気通信サービス
ENDESA SA	21.5	41	5,363	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	523.05	318	40,767	金融
IBERDROLA SA	468.86	312	39,938	公益事業
BANCO DE SABADELL SA	496.34	72	9,325	金融
BANKINTER SA	67	58	7,436	金融
REPSOL SA	102.13	175	22,493	エネルギー
GRIFOLS SA	30.04	82	10,608	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	1,298.09	621	79,468	金融
AMADEUS IT GROUP SA	36.95	266	34,139	情報技術
GAS NATURAL SDG SA	21	45	5,852	公益事業
MAPFRE SA	80.05	20	2,644	金融
CAIXABANK S. A	304.87	117	15,039	金融
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	49	40	5,132	資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21.95	80	10,331	資本財・サービス
AENA SME SA	5.69	91	11,647	資本財・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	96.55	289	37,083	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	17.93	23	3,015	資本財・サービス
ENAGAS SA	36.75	90	11,525	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA	40.56	72	9,283	公益事業
FERROVIAL SA	38.76	71	9,136	資本財・サービス
BANKIA SA	159.05	53	6,892	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,321.81 22銘柄	3,254 416,295	<1.2%>
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (イタリア)				
PRYSMIAN SPA	14.4	37	4,733	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	117.33	172	22,112	金融
MEDIOBANCA SPA	44.6	36	4,658	金融
UNICREDIT SPA	176.37	256	32,753	金融
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	74	9,492	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP	483.81	29	3,711	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO-RSP	93.84	25	3,228	金融
INTESA SANPAOLO	1,027.4	266	34,086	金融
ATLANTIA SPA	35.27	88	11,349	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	29	22	2,900	金融
MONCLER SPA	15.22	64	8,210	一般消費財・サービス
RECORDATI SPA	6.92	23	2,947	ヘルスケア
ENI SPA	211.46	334	42,770	エネルギー
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	44.83	31	3,970	生活必需品
PIRELLI & C SPA	56.51	41	5,348	一般消費財・サービス
LEONARDO SPA	25	22	2,877	資本財・サービス
ENEL SPA	711.57	346	44,349	公益事業
SNAM SPA	243	87	11,229	エネルギー
LUXOTTICA GROUP SPA	13.07	72	9,287	一般消費財・サービス
TERNA SPA	99	46	5,895	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,533.63 20銘柄	2,079 265,912	<0.7%>

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フィンランド)				
UPM-KYMMENE OYJ	44.93	143	18,302	素材
NOKIA OYJ	439.04	229	29,413	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	41.16	72	9,241	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	41.93	74	9,516	素材
METSO OYJ	11.08	34	4,393	資本財・サービス
ELISA OYJ	13	51	6,527	電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS	38.32	161	20,712	金融
FORTUM OYJ	44	89	11,424	公益事業
KONE OYJ-B	26.6	118	15,163	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ	17.7	61	7,873	一般消費財・サービス
NESTE OYJ	11	73	9,426	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	17.63	43	5,506	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	746.39 12銘柄	1,153 <0.4%>	147,500
ユーロ (オーストリア)		百株	千ユーロ	千円
OMV AG	12.09	61	7,821	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	27.5	99	12,764	金融
VOESTALPINE AG	8	35	4,577	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	11	30	3,939	金融
ANDRITZ AG	5.5	24	3,090	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	64.09 5銘柄	251 <0.1%>	32,193
ユーロ (その他)		百株	千ユーロ	千円
STMICROELECTRONICS NV	49.17	111	14,237	情報技術
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	49.17 1銘柄	111 <0.0%>	14,237
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	16,570.79 240銘柄	34,372 <12.2%>	4,396,201
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	95,274.56 1,250銘柄	— <95.8%>	34,565,920

(注1) 邦貨換算金額は、2018年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	2018年6月15日現在		
	口数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)			
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.072	180	19,954
SIMON PROPERTY GROUP INC	2.794	458	50,730
BOSTON PROPERTIES INC	1.15	137	15,258
GGP INC	6.391	132	14,663
VORNADO REALTY TRUST	1.156	83	9,204
SBA COMMUNICATIONS CORP	1.055	165	18,332
EQUITY RESIDENTIAL	2.85	181	20,109
EQUINIX INC	0.706	280	31,001
AMERICAN TOWER CORP	3.691	510	56,518
HOST HOTELS & RESORTS INC	6.228	132	14,703
KIMCO REALTY CORP	3.3	54	6,037
INVITATION HOMES INC	2.2	49	5,459
VENTAS INC	2.7	146	16,259
WEYERHAEUSER CO	5.858	218	24,158
AGNC INVESTMENT CORP	4.334	82	9,114
CROWN CASTLE INTL CORP	3.493	353	39,112
IRON MOUNTAIN INC	1.718	58	6,463
VEREIT INC	7.75	56	6,210
PROLOGIS INC	4.806	309	34,266
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.7	89	9,890
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.65	58	6,486
DUKE REALTY CORP	3.1	88	9,795
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.6	140	15,594
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.45	54	6,031
WELLTOWER INC	2.947	169	18,800
HCP INC	4.55	108	12,020
LIBERTY PROPERTY TRUST	1	44	4,900
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.1	106	11,793
MACERICH CO/THE	0.7	39	4,347
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	9.6	100	11,177
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1.552	65	7,243
REALTY INCOME CORP	2.55	135	14,955
PUBLIC STORAGE	1.3	278	30,857
REGENCY CENTERS CORP	1.15	69	7,638
SL GREEN REALTY CORP	0.65	63	7,038
UDR INC	1.9	70	7,801

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年6月15日現在		
	□ 数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
DIGITAL REALTY TRUST INC EXTRA SPACE STORAGE INC	千口 1.8 1.285	千アメリカ・ドル 191 125	千円 21,243 13,871
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 > 100.836 38銘柄	5,593	619,047 <1.7%>
(カナダ) H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	千口 2 1.4	千カナダ・ドル 40 33	千円 3,393 2,819
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 > 3.4 2銘柄	73	6,212 <0.0%>
(オーストラリア) LENDLEASE GROUP TRANSURBAN GROUP SYDNEY AIRPORT APA GROUP SCENTRE GROUP DEXUS GPT GROUP MIRVAC GROUP STOCKLAND GOODMAN GROUP VICINITY CENTRES	千口 4.303 17.162 9.129 7.5 43.529 6.5 14.648 31.638 14.3 14.731 19.523	千オーストラリア・ドル 81 204 66 72 183 62 73 70 59 139 51	千円 6,711 16,883 5,477 5,948 15,124 5,149 6,056 5,822 4,897 11,537 4,253
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 > 182.963 11銘柄	1,064	87,863 <0.2%>
(香港) LINK REIT HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS HKT TRUST AND HKT LTD-SS	千口 18 52 34	千香港ドル 1,285 387 340	千円 18,121 5,462 4,803
香港ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 > 104 3銘柄	2,013	28,387 <0.1%>
(シンガポール) CAPITALAND COMMERCIAL TRUST ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT CAPITALAND MALL TRUST SUNTEC REIT	千口 28 30.5 9 26	千シンガポール・ドル 45 79 18 44	千円 3,774 6,568 1,501 3,633
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 > 93.5 4銘柄	188	15,478 <0.0%>
(イギリス) LAND SECURITIES GROUP PLC SEGRO PLC HAMMERSON PLC BRITISH LAND CO PLC	千口 4.808 5.92 10.958 6.3	千イギリス・ポンド 45 39 58 43	千円 6,724 5,817 8,604 6,393
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 > 27.986 4銘柄	187	27,540 <0.1%>
ユーロ (フランス) UNIBAIL GROUP STAPLED ICADE GECINA SA KLEPIERRE COVIVIO	千口 1.249 0.406 0.334 2.394 0.353	千ユーロ 239 33 47 79 31	千円 30,591 4,268 6,134 10,220 4,045
ユーロ通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 > 4.736 5銘柄	432	55,260 <0.2%>
合計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 > 517.421 67銘柄	—	839,789 <2.3%>

(注1) 邦貨換算金額は、2018年6月15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	2018年6月15日現在	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
外 S&P500 E-MINI FUTURE (アメリカ)	678	—
S&P/TSE 60 INDEX (カナダ)	97	—
SPI 200 INDEX (オーストラリア)	74	—
FT 100 (イギリス)	90	—
国内 SMI (スイス)	57	—
EURO STOXX 50 (ドイツ)	229	—

(注1) 外貨建の評価額は、2018年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

運用報告書 第10期 (決算日 2018年1月10日)

(計算期間 2017年1月11日～2018年1月10日)

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの第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。

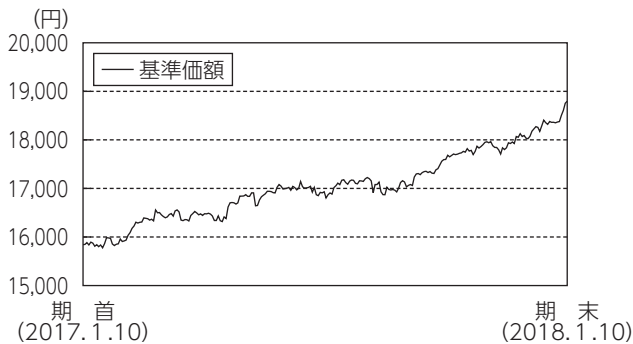
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式(上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。)
運用方法	①主として海外の株式(預託証券を含みます。)に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。 ③運用の効率化を図るため、株式指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等の組入総額ならびに株式指数先物取引等の買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

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
http://www.daiwa-am.co.jp/

■当期中の基準価額と市況の推移



年月日	基準価額		MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース、指数化)		株式比率	株式先物比率	投資信託受託証券組入比率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率				
(期首)2017年1月10日	15,841	-	12,919	-	91.1%	5.6%	-	2.5%
1月末	15,856	0.1	12,928	0.1	91.0	4.7	-	2.3
2月末	16,366	3.3	13,319	3.1	91.7	5.5	-	2.4
3月末	16,526	4.3	13,429	3.9	93.2	6.1	-	2.4
4月末	16,704	5.4	13,547	4.9	92.0	5.8	-	2.4
5月末	16,912	6.8	13,665	5.8	93.2	4.6	-	2.4
6月末	16,870	6.5	13,609	5.3	95.9	3.5	0.0	2.5
7月末	17,104	8.0	13,789	6.7	94.3	2.4	0.0	2.6
8月末	17,011	7.4	13,676	5.9	95.3	2.3	0.0	2.7
9月末	17,408	9.9	13,975	8.2	97.4	2.7	0.0	2.6
10月末	17,832	12.6	14,303	10.7	94.9	2.7	0.0	2.5
11月末	18,054	14.0	14,451	11.9	92.9	3.6	0.0	2.5
12月末	18,377	16.0	14,688	13.7	94.5	4.2	0.0	2.5
(期末)2018年1月10日	18,797	18.7	15,025	16.3	93.4	3.9	0.0	2.4

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：15,841円 期末：18,797円 騰落率：18.7%

【基準価額の主な変動要因】

MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なった結果、良好な経済指標や米国の税制改革法成立を期待して海外株式市況が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○外国株式市況

米国・欧州を中心とする外国株式市況は、期首より、米国トランプ大統領による大型インフラ(社会基盤)投資への期待の高まりやイエレンFRB(米国連邦準備制度理事会)議長が議会証言において米国経済に楽観的

な見方を示したことなどをを受け、上昇して始まりました。2017年4月以降は、フランス大統領選挙の行方、またシリア情勢や朝鮮半島の緊迫化など地政学リスクへの警戒感などを背景に一時的に神経質な展開となりましたが、フランス大統領選挙の第1回投票が世論調査通りの結果となり安心感が広がると、市況は再び上昇基調に転じました。その後も、北朝鮮による6回目の核実験や米国南部に襲来した大型ハリケーンなど投資家心理が悪化する場面もありましたが、良好な決算発表や景況感の改善などを背景に、市況は底堅く推移しました。12月以降も、英国のEU(欧州連合)離脱条件をめぐる交渉が合意に近づいたことを好感した買いや米国税制改革法成立への期待感の高まりなどから、市況の上昇基調は継続して期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマーク(MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース))の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

◆ポートフォリオについて

ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式(投資信託証券、株式先物を含む。)等のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・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16.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は18.7%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式) (先物) (投資信託受益証券) (投資信託証券)	4円 (3) (0) (0) (0)
有価証券取引税 (株式) (投資信託受益証券) (投資信託証券)	6 (6) (0) (0)
その他費用 (保管費用) (その他)	17 (16) (1)
合計	27

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2017年1月11日から2018年1月10日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	アメリカ	百株 12,320.9 (71.17)	千アメリカ・ドル 85,224 (△ 717)	百株 1,269.88	千アメリカ・ドル 7,409
	カナダ	百株 1,722.5 (△ 26.7)	千カナダ・ドル 6,638 ()	百株 214.32	千カナダ・ドル 519
	オーストラリア	百株 2,524.19 (△ 364.22)	千オーストラリア・ドル 4,188 (△ 270)	百株 204.3	千オーストラリア・ドル 244
	香港	百株 5,091 (△ 101.42)	千香港ドル 13,906 (△ 331)	百株 343.44	千香港ドル 1,097
	シンガポール	百株 1,540 ()	千シンガポール・ドル 843 ()	百株 122	千シンガポール・ドル 44
	ニュージーランド	百株 206.79 ()	千ニュージーランド・ドル 115 ()	百株 -	千ニュージーランド・ドル -
	イギリス	百株 12,072.36 (△ 39.41)	千イギリス・ポンド 7,367 (△ 6)	百株 401.44	千イギリス・ポンド 237
	イスラエル	百株 120.48 ()	千イスラエル・シケル 424 ()	百株 -	千イスラエル・シケル -
	スイス	百株 656.26 (7.33)	千スイス・フラン 4,481 (△ 47)	百株 41.44	千スイス・フラン 714
	デンマーク	百株 254.62 ()	千デンマーク・クローネ 6,673 ()	百株 12.3	千デンマーク・クローネ 427
	ノルウェー	百株 210.62 ()	千ノルウェー・クローネ 2,600 (△ 29)	百株 -	千ノルウェー・クローネ -
	スウェーデン	百株 873.39 (58.16)	千スウェーデン・クローネ 13,381 (△ 4)	百株 95.37	千スウェーデン・クローネ 1,338
	ユーロ (アイルランド)	百株 123.76 (△ 1,517.66)	千ユーロ 208 ()	百株 -	千ユーロ -
	ユーロ (オランダ)	百株 806.35 (△ 0.51)	千ユーロ 1,853 (△ 1)	百株 24.04	千ユーロ 61
	ユーロ (ベルギー)	百株 74.22 (8)	千ユーロ 534 ()	百株 6.99	千ユーロ 28
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 50.94 (△ 60)	千ユーロ 77 ()	百株 -	千ユーロ -
	ユーロ (フランス)	百株 1,126.57 (0.83)	千ユーロ 4,507 (△ 6)	百株 38.91	千ユーロ 225
	ユーロ (ドイツ)	百株 981.48 (15)	千ユーロ 4,512 (△ 23)	百株 30.78	千ユーロ 130
	ユーロ (ポルトガル)	百株 112.09 ()	千ユーロ 51 ()	百株 -	千ユーロ -
ユーロ (スペイン)	百株 2,111.74 (△ 291.52)	千ユーロ 1,578 (△ 6)	百株 186.58	千ユーロ 78	
ユーロ (イタリア)	百株 2,744.28 (131)	千ユーロ 1,093 (△ 35)	百株 92.65	千ユーロ 54	
ユーロ (フィンランド)	百株 336.44 ()	千ユーロ 491 ()	百株 6.17	千ユーロ 28	
ユーロ (オーストリア)	百株 32.09 ()	千ユーロ 111 (△ 2)	百株 -	千ユーロ -	
ユーロ (その他)	百株 61.17 (4)	千ユーロ 106 ()	百株 33	千ユーロ 82	
ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 8,561.13 (△ 1,972.86)	千ユーロ 15,127 (△ 75)	百株 419.12	千ユーロ 691	

(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) 投資信託受益証券

(2017年1月11日から2018年1月10日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	千口 70 ()	千アメリカ・ドル 28 ()	千口 -	千アメリカ・ドル -

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

(3) 投資信託証券

(2017年1月11日から2018年1月10日まで)

	買 付		売 付		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
外 国	アメリカ	千口 50.39 (1.078)	千アメリカ・ドル 2,772 (51)	千口 2,778 ()	千アメリカ・ドル 252 ()
	カナダ	千口 3.4 ()	千カナダ・ドル 80 ()	千口 -	千カナダ・ドル -
	オーストラリア	千口 77.443 (25.756)	千オーストラリア・ドル 503 (240)	千口 4,552 ()	千オーストラリア・ドル 45 ()
	香港	千口 4 (34)	千香港ドル 210 (331)	千口 -	千香港ドル -
	シンガポール	千口 54 ()	千シンガポール・ドル 106 (△ 0)	千口 -	千シンガポール・ドル -
	イギリス	千口 22.604 (△ 0.321)	千イギリス・ポンド 113 (△ 3)	千口 8,425 ()	千イギリス・ポンド 16 ()
	ユーロ (フランス)	千口 1.992 ()	千ユーロ 171 (△ 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。

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2017年1月11日から2018年1月10日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国 株式先物取引	百万円 6,416	百万円 6,053	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2017年1月11日から2018年1月10日まで)

銘 柄	買 付			売 付		
	株 数	金 額	平均単価	株 数	金 額	平均単価
APPLE INC (アメリカ)	千株 20	千円 328,193	円 16,409	千株 4.85	千円 28,240	円 5,822
MICROSOFT CORP (アメリカ)	29.4	231,546	7,875	1.6	28,079	17,549
AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.68	178,991	106,542	0.535	27,684	51,746
FACEBOOK INC-A (アメリカ)	10.05	170,810	16,996	0.625	19,908	31,853
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	17.25	158,507	9,188	2.681	19,286	7,193
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	10.914	155,816	14,276	1.2	18,047	15,039
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	13.6	138,271	10,166	1.95	16,649	8,537
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	1.27	128,242	100,978	0.85	16,465	19,371
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	1.19	122,021	102,538	0.13	14,224	109,415
WELLS FARGO & CO (アメリカ)	18.4	114,674	6,232	2.902	13,670	4,710

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
(1) 外国株式

銘柄	期首		当		期		業	種	等
	株	数	株	数	評				
					価	額			
					外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円					
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	3.5	7.5	69	7,869	情報技術				
PALO ALTO NETWORKS INC	2.5	6	91	10,275	情報技術				
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1	5.5	78	8,846	ヘルスケア				
SYNCHRONY FINANCIAL	27.5	51	201	22,618	金融				
ABBOTT LABORATORIES	55.7	117.2	690	77,651	ヘルスケア				
ARCONIC INC	15	24	71	8,045	資本財・サービス				
VERISK ANALYTICS INC	5	11.35	109	12,345	資本財・サービス				
LAS VEGAS SANDS CORP	14	29	201	22,670	一般消費財・サービス				
AMPHENOL CORP-CL A	8	19.5	177	19,912	情報技術				
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	10.5	23.5	225	25,379	情報技術				
QORVO INC	2	7	48	5,431	情報技術				
AFLAC INC	13.5	30	270	30,361	金融				
DARDEN RESTAURANTS INC	5	8	77	8,770	一般消費財・サービス				
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	-	10	43	4,916	一般消費財・サービス				
ADOBE SYSTEMS INC	16	33	616	69,281	情報技術				
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11	17.5	74	8,357	素材				
LULULEMON ATHLETICA INC	2	5.5	43	4,917	一般消費財・サービス				
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	5	19	36	4,074	金融				
GARMIN LTD	2	7.5	44	5,047	一般消費財・サービス				
AETNA INC	10.44	21.94	402	45,296	ヘルスケア				
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6.5	14	236	26,615	素材				
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	22.5	51	795	89,470	資本財・サービス				
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7	11.5	92	10,434	情報技術				
WR BERKELEY CORP	2	6	41	4,641	金融				
AUTOTON INC	1	1.9	146	16,471	一般消費財・サービス				
DOLLAR TREE INC	8.49	15.99	175	19,723	一般消費財・サービス				
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	32	56	108	12,197	ヘルスケア				
PINNACLE WEST CAPITAL	5	9	73	8,300	公益事業				
CELANESE CORP-SERIES A	6	9	97	10,978	素材				
DR HORTON INC	14.5	23.5	124	13,960	一般消費財・サービス				
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4.5	4.5	24	2,806	エネルギー				
DENTSPLY SIRONA INC	7	15.5	101	11,407	ヘルスケア				
AUTODESK INC	7	12.5	140	15,758	情報技術				
MOODY'S CORP	5.5	12.5	195	21,944	金融				
DEVON ENERGY CORP	13	34	144	16,264	エネルギー				
ALBEMARLE CORP	3	8	108	12,184	素材				
ATMOS ENERGY CORP	3	6	49	5,572	公益事業				
ALLIANT ENERGY CORP	6	13	53	5,980	公益事業				
CITIGROUP INC	91.8	189.8	1,429	160,734	金融				
AUTOMATIC DATA PROCESSING	14	30.5	362	40,731	情報技術				
AMERICAN ELECTRIC POWER	16.5	32.5	229	25,794	公益事業				
ALLEGHANY CORP	0.3	0.8	46	5,224	金融				
DUN & BRADSTREET CORP	1	-	-	-	資本財・サービス				
DOMINO'S PIZZA INC	1.5	3	62	6,973	一般消費財・サービス				
HESS CORP	8.5	19.5	102	11,503	エネルギー				
DAVITA INC	6	10	77	8,711	ヘルスケア				
DANAHER CORP	19	41.3	407	45,796	ヘルスケア				
FORTIVE CORP	10	19	140	15,763	資本財・サービス				
AVNET INC	4	11	46	5,190	情報技術				
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	18.25	41.25	305	34,348	金融				
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2	12	18	2,038	一般消費財・サービス				
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	2.01	17.01	23	2,697	一般消費財・サービス				
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	19.5	37.5	150	16,960	生活必需品				
BUNGE LTD	3	9.5	66	7,438	生活必需品				
TE CONNECTIVITY LTD	13	24	237	26,669	情報技術				
APPLE INC	171.5	355.5	6,197	696,901	情報技術				
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14	27	211	23,754	金融				
BOEING CO/THE	18.5	39.3	1,251	140,723	資本財・サービス				
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6	9.5	69	7,820	金融				
SPECTRA ENERGY CORP	23.5	-	-	-	その他				
BECTON DICKINSON AND CO	6.73	19.11	432	48,655	ヘルスケア				
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	-	15	41	4,672	一般消費財・サービス				
LEIDOS HOLDINGS INC	-	8.5	56	6,331	情報技術				
CDK GLOBAL INC	6	11	79	8,910	情報技術				
NISOURCE INC	9	20	49	5,555	公益事業				
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3	10.5	96	10,798	資本財・サービス				
CR BARD INC	2	-	-	-	その他				
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32	72.5	402	45,295	金融				
VERIZON COMMUNICATIONS INC	127.44	283.44	1,462	164,495	電気通信サービス				
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	37	86.2	1,750	196,971	金融				
ANSYS INC	2	4.5	69	7,850	情報技術				
H&R BLOCK INC	3	16	42	4,757	一般消費財・サービス				
BB&T CORP	24.5	54	281	31,630	金融				
BAKER HUGHES INC	13.81	-	-	-	その他				
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	52.5	110	680	76,505	ヘルスケア				
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1	-	-	-	生活必需品				
JPMORGAN CHASE & CO	113	240	2,617	294,304	金融				
T ROWE PRICE GROUP INC	7.5	15.5	173	19,477	金融				
CIGNA CORP	8	16.5	342	38,568	ヘルスケア				
LKQ CORP	12	20.5	86	9,679	一般消費財・サービス				
COMPUTER SCIENCES CORP	5	-	-	-	その他				
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	2	2	23	2,656	金融				
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	19.21	-	-	-	電気通信サービス				
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9	14.5	97	10,997	生活必需品				
CADENCE DESIGN SYS INC	8	17	76	8,615	情報技術				
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5.5	9.5	165	18,596	金融				
DOLLAR GENERAL CORP	7.5	18.5	174	19,607	一般消費財・サービス				
SERVICENOW INC	6	11.5	155	17,516	情報技術				
CATERPILLAR INC	17.5	41	682	76,731	資本財・サービス				
CMS ENERGY CORP	11	17	77	8,738	公益事業				

銘柄	期首		当		期		業	種	等
	株	数	株	数	評				
					価	額			
					外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円					
MOSAIC CO/THE	7	30	78	8,808	素材				
DELTA AIR LINES INC	4	10	54	6,091	資本財・サービス				
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	7	-	-	-	その他				
CORNING INC	31	59	198	22,325	情報技術				
CISCO SYSTEMS INC	157.5	348.5	1,383	155,540	情報技術				
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	26	-	-	-	その他				
MORGAN STANLEY	43.5	92.5	493	55,440	金融				
WABCO HOLDINGS INC	1.2	3.2	47	5,391	資本財・サービス				
DOW CHEMICAL CO/THE	33.5	-	-	-	その他				
MSCI INC	1.5	7.3	97	11,008	金融				
LENNOX INTERNATIONAL INC	-	2.2	46	5,236	資本財・サービス				
MIDDLEBY CORP	2	4	53	6,039	資本財・サービス				
COTY INC-CL A	11.17	24.17	49	5,596	生活必需品				
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	-	10	42	4,753	情報技術				
BROADCOM LTD	11.84	27.24	731	82,245	情報技術				
UNITED THERAPEUTICS CORP	1	3	45	5,073	ヘルスケア				
DICK'S SPORTING GOODS INC	2	-	-	-	一般消費財・サービス				
ACUIITY BRANDS INC	1	3.5	55	6,216	資本財・サービス				
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	-	7	91	10,291	ヘルスケア				
ARAMARK	10	17	74	8,329	一般消費財・サービス				
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	5	14	46	5,181	素材				
DTE ENERGY COMPANY	5	13.5	142	16,043	公益事業				
CENTENE CORP	5	12	127	14,299	ヘルスケア				
CBOE GLOBAL MARKETS INC	-	6	78	8,824	金融				
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15.5	30.5	134	15,155	金融				
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7.5	12	76	8,586	金融				
GARTNER INC	2.5	5	64	7,250	情報技術				
SPLUNK INC	6.5	11	98	11,066	情報技術				
WHITEWAVE FOODS CO	7.5	-	-	-	その他				
AGCO CORP	1	5	36	4,150	資本財・サービス				
DOMINION ENERGY INC	18.5	44.5	343	38,636	公益事業				
MONSTER BEVERAGE CORP	10.5	27.5	180	20,248	生活必需品				
SMITH (A.O.) CORP	3	5	50	5,689	資本財・サービス				
DEERE & CO	8	18.5	306	34,450	資本財・サービス				
GLOBAL PAYMENTS INC	5.5	12	125	14,143	情報技術				
TIME WARNER INC	25.16	51.66	476	53,606	一般消費財・サービス				
VMWARE INC-CLASS A	2	5	64	7,268	情報技術				
CHEMOURS CO/THE	-	14	70	7,918	素材				
TEGNA INC	11.5	-	-	-	一般消費財・サービス				
NASDAQ INC	5	8.5	68	7,662	金融				
VAIL RESORTS INC	-	2.4	51	5,757	一般消費財・サービス				
EAST WEST BANCORP INC	-	8.5	54	6,161	金融				
TARGA RESOURCES CORP	6	11	53	6,001	エネルギー				
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2.5	4.5	71	8,092	金融				
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	-	4.5	48	5,451	金融				
CONSOLIDATED EDISON INC	11	22.5	184	20,749	公益事業				
COGNEX CORP	-	14	94	10,664	情報技術				
MEDNAX INC	3	-	-	-	ヘルスケア				
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	5	7.5	85	9,561	一般消費財・サービス		</		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価価額		業種等		
			外貨建金額	邦貨換算金額	業種等	業種等	
KINDER MORGAN INC	58.96	146.96	278	31,299	エネルギー		
HCA HEALTHCARE INC	11	22	189	21,275	ヘルスケア		
CABOT OIL & GAS CORP	18	29.5	85	9,659	エネルギー		
T-MOBILE US INC	10.5	19.5	127	14,384	電気通信サービス		
ZILLOW GROUP INC - C	-	7	29	3,319	情報技術		
COCA-COLA CO/THE	128.5	283	1,308	147,119	生活必需品		
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	-	16	63	7,133	生活必需品		
EXPEDITORS INTL WASH INC	7.5	12.5	82	9,284	資本財・サービス		
EATON VANCE CORP	6	6	35	3,954	金融		
FMC TECHNOLOGIES INC	11	-	-	-	その他		
FRANKLIN RESOURCES INC	15	22	96	10,801	金融		
CSX CORP	31	64.5	382	42,981	資本財・サービス		
FLUOR CORP	3	7	37	4,235	資本財・サービス		
LABORATORY CORP OF AMER HLDGS	3.5	7.5	127	14,382	ヘルスケア		
EXPEDIA INC	4	8	101	11,450	一般消費財・サービス		
AUTOLIV INC	3.5	5.5	72	8,206	一般消費財・サービス		
AMAZON.COM INC	12.7	28.2	3,532	397,242	一般消費財・サービス		
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	7	16	48	5,424	エネルギー		
FLOWSERVE CORP	3	9	38	4,382	資本財・サービス		
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7.5	13	155	17,470	ヘルスケア		
EXXON MOBIL CORP	131.76	294.26	2,553	287,117	エネルギー		
FLIR SYSTEMS INC	1	8	39	4,443	情報技術		
AES CORP	17	40	43	4,839	公益事業		
L3 TECHNOLOGIES INC	2.5	6.5	133	14,983	資本財・サービス		
EVEREST RE GROUP LTD	1	3.5	75	8,538	金融		
EOG RESOURCES INC	19	39.5	441	49,619	エネルギー		
EQT CORP	6	19	111	12,541	エネルギー		
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7	12.5	84	9,486	情報技術		
AMERISOURCEBERGEN CORP	7	10	97	10,966	ヘルスケア		
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9.5	25	179	20,176	ヘルスケア		
FORD MOTOR CO	108.5	247.5	323	36,403	一般消費財・サービス		
TESARO INC	-	2	15	1,717	ヘルスケア		
MACY'S INC	12	22	54	6,108	一般消費財・サービス		
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	2	11	23	2,677	一般消費財・サービス		
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5.16	12.16	42	4,792	一般消費財・サービス		
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	3	12.5	25	2,881	一般消費財・サービス		
MOBILEYE NV	5	-	-	-	情報技術		
AERCAP HOLDINGS NV	8.5	8.5	45	5,111	資本財・サービス		
FORTINET INC	3.5	10.5	46	5,232	情報技術		
MARKEL CORP	10.5	1.1	123	13,886	金融		
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	-	8	18	2,061	エネルギー		
NEXTERA ENERGY INC	14	33.3	505	56,857	公益事業		
FREEMANTLE-MCMORAN INC	38.5	94.5	178	20,105	素材		
US BANCORP	54	112	624	70,251	金融		
UNITED RENTALS INC	2	6	103	11,633	資本財・サービス		
F5 NETWORKS INC	3	5.5	75	8,525	情報技術		
FASTENAL CO	9.5	20.5	113	12,761	資本財・サービス		
FISERV INC	6.5	15	204	22,988	情報技術		
GENERAL ELECTRIC CO	281.5	607.5	1,127	126,789	資本財・サービス		
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	7.5	12.5	68	7,722	一般消費財・サービス		
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	11.5	22.5	76	8,574	一般消費財・サービス		
GENERAL MOTORS CO	44	89	392	44,085	一般消費財・サービス		
TRIPADVISOR INC	2	7	24	2,722	一般消費財・サービス		
GENERAL DYNAMICS CORP	8.5	17.5	360	40,514	資本財・サービス		
GOLDMAN SACHS GROUP INC	11.5	26.1	662	74,529	金融		
ALPHABET INC-CL A	9.3	20.7	2,303	259,025	情報技術		
ALPHABET INC-CL C	9.71	21.71	2,401	270,070	情報技術		
OWENS CORNING	-	8	75	8,469	資本財・サービス		
GENERAL MILLS INC	19	37.5	222	25,014	生活必需品		
FIRSTENERGY CORP	13.17	30.17	90	10,198	公益事業		
GENUINE PARTS CO	5.5	12	118	13,352	一般消費財・サービス		
IHS MARKIT LTD	13.55	26.05	121	13,709	資本財・サービス		
FIFTH THIRD BANCORP	23.5	45.5	142	15,988	金融		
HARRIS CORP	5	7.5	109	12,281	資本財・サービス		
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3	9.5	49	5,563	資本財・サービス		
HALLIBURTON CO	25	59.5	310	34,865	エネルギー		
HOMER DEPOT INC	39.5	82	1,583	178,055	一般消費財・サービス		
ASSURANT INC	2.5	2.5	24	2,786	金融		
HUNTINGTON BANCSHARES INC	36.5	76.5	116	13,101	金融		
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2	3.5	83	9,414	資本財・サービス		
HERSHEY CO/THE	4.5	9.5	108	12,154	生活必需品		
HARLEY-DAVIDSON INC	4	14	73	8,228	一般消費財・サービス		
HUMANA INC	4.5	9.5	249	28,104	ヘルスケア		
NXP SEMICONDUCTORS NV	10	20.5	242	27,305	情報技術		
HELMERICH & PAYNE	6	6	40	4,602	エネルギー		
HENRY SCHEIN INC	2.5	11	80	9,085	ヘルスケア		
HP INC	58	107.5	234	26,364	情報技術		
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	50	102.5	152	17,116	情報技術		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM.C	4	11	43	4,894	一般消費財・サービス		
HOLLYFRONTIER CORP	2	11	56	6,340	エネルギー		
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	-	13.5	45	5,093	一般消費財・サービス		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM.A	2	8.5	33	3,800	一般消費財・サービス		
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5	8	69	7,847	金融		
HARMAN INTERNATIONAL	1.5	-	-	-	その他		
KRAFT HEINZ CO/THE	18.5	40	314	35,363	生活必需品		
INTL BUSINESS MACHINES CORP	29	60	982	110,536	情報技術		
INTERNATIONAL PAPER CO	13.5	30.5	187	21,089	素材		
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4	9	63	7,116	資本財・サービス		
ZOETIS INC	16.5	36.5	274	30,828	ヘルスケア		
INGERSOLL-RAND PLC	9.65	16.65	151	17,017	資本財・サービス		
CHENIERE ENERGY INC	5	17.5	94	10,614	エネルギー		
ALLEGION PLC	-	5.5	45	5,129	資本財・サービス		

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価価額		業種等		
			外貨建金額	邦貨換算金額	業種等	業種等	
LEGGETT & PLATT INC	2	6.5	31	3,504	一般消費財・サービス		
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18.86	35.86	119	13,480	一般消費財・サービス		
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	1.35	-	-	-	その他		
WASTE CONNECTIONS INC	7	20	140	15,792	資本財・サービス		
JUNIPER NETWORKS INC	9	28.5	81	9,175	情報技術		
JM SMUCKER CO/THE	4	9	114	12,831	生活必需品		
JOHNSON & JOHNSON	86	183.14	2,639	296,843	ヘルスケア		
ABBVIE INC	51.66	111.66	1,119	125,863	ヘルスケア		
HOLOGIC INC	11	18	79	8,950	ヘルスケア		
KIMBERLY-CLARK CORP	10.5	23	268	30,208	生活必需品		
KROGER CO	30	56	155	17,487	生活必需品		
KLA-TENCOR CORP	5	11	120	13,507	情報技術		
LOCKHEED MARTIN CORP	8.2	17.9	591	66,526	資本財・サービス		
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3.3	7.3	143	16,164	情報技術		
L BRANDS INC	8.5	19.5	92	10,389	一般消費財・サービス		
LOWE'S COS INC	27.5	58	548	61,666	一般消費財・サービス		
ELI LILLY & CO	31.5	71	611	68,709	ヘルスケア		
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	10	-	-	-	その他		
LAM RESEARCH CORP	6	10.5	207	23,327	情報技術		
RANGE RESOURCES CORP	3	10	17	1,918	エネルギー		
JONES LANG LASALLE INC	1	3	46	5,191	不動産		
LOEWS CORP	12	18	92	10,349	金融		
LINCOLN NATIONAL CORP	9	13	106	11,940	金融		
MCDONALD'S CORP	26	57	989	111,233	一般消費財・サービス		
3M CO	19	42	1,013	113,954	資本財・サービス		
FACEBOOK INC-A	72.5	164.5	3,090	347,522	情報技術		
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	8.17	12.17	102	11,533	情報技術		
MANPOWERGROUP INC	1	3.5	45	5,135	資本財・サービス		
S&P GLOBAL INC	9	16.9	299	33,682	金融		
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2.3	3.5	79	8,973	素材		
CONCHO RESOURCES INC	4	9.5	147	16,557	エネルギー		
ENVISION HEALTHCARE CORP	5.33	5.33	18	2,092	ヘルスケア		
FIRST DATA CORP- CLASS A	18.5	38.5	66	7,476	情報技術		
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	8	8	29	3,266	電気通信サービス		
PHILLIPS 66	15.5	29.97	304	34,280	エネルギー		
CONDUENT INC	7.51	-	-	-	情報技術		
HILTON GRAND VACATIONS INC	1.75	-	-	-	一般消費財・サービス		
MURPHY OIL CORP	3	-	-	-	エネルギー		
TECHNIPFMC PLC	-	29	93	10,559	エネルギー		
MGM RESORTS INTERNATIONAL	18	28	94	10,588	一般消費財・サービス		
MATTEL INC	14	14	22	2,490	一般消費財・サービス		
DXC TECHNOLOGY CO	-	20.38	207	23,290	情報技術		
MCCORMICK & CO-NON VGTG SHRS	4.5	7	72	8,117	生活必需品		
MYLAN NV	12.5	36.5	161	18,178	ヘルスケア		
METLIFE INC	28	59	308	34,738	金融		
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	22	22	50	5,727	情報技術		
ARISTA NETWORKS INC	-	2.5	62	7,027	情報技術		
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	-	5	25	2,839	金融		
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4.35	10.85	99	11,239	情報技術		
MONSANTO CO	15	30.5	363	40,923	素材		
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1	1.5	97	10,963	ヘルスケア		
BAKER HUGHES A GE CO	-	23.31	81	9,182	エネルギー		
ROCKWELL AUTOMATION INC	4	9	182	20,519	資本財・サービス		
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	-	5.36	33	3,719	金融		
MERCK & CO. INC.	87.87	190.37	1,081	121,592	ヘルスケア		
DOWDUPONT INC	-	163.3	1,230	138,347	素材		
MASCO CORP	8	22	99	11,238	資本財・サービス		
M & T BANK CORP	4.32	10.32	180	20,298	金融		
MARSH & MCLENNAN COS	16.5	35	286	32,269	金融		
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	10.95	21.95	302	33,990	一般消費財・サービス		
WORKDAY INC-CLASS A	5	8	87	9,868	情報技術		
SQUARE INC - A	-	19	77	8,734	情報技術		
TRANSUNION	-	12	68	7,648	資本財・サービス		
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	4	11	70	7,894	一般消費財・サービス		
VANTIV INC - CL A	4	13.6	104	11,789	情報技術		
NETAPP INC	10	16	95	10,735	情報技術		
NIKE INC - CL B	43.5	89	570	64,141	一般消費財・サービス		
NORFOLK SOUTHERN CORP	10	19	291	32,817	資本財・サービス		
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5	16.5	152	17,164	情報技術		
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3	10.5	97	10,998	金融		
ALLY FINANCIAL INC	19	33	100	11,273	金融		
NORTHROP GRUMMAN CORP	5.5	12	372	41,884	資本財・サービス		
APTIV PLC	9	21	194	21,902	一般消費財・サービス		
NEWMONT MINING CORP	15.5	31.5	120	13,499	素材		
MCKESSON CORP	7	15	240	27,095	ヘルスケア		
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	6	18	96	10,893	情報技術		
XYLEM INC	7.5	13	90	10,159	資本財・サービス		
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	49.5	109	1,143	128,564	生活必需品		
NUCOR CORP	9	21.5	145				

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	
STRYKER CORP	11	23.5	377	42,487	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	4	9.7	201	22,613	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5.5	11.5	204	23,012	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	1	4	50	5,707	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	80.7	173.2	1,576	177,332	生活必需品
EXELON CORP	28.04	68.54	261	29,411	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	8	14	170	19,174	ヘルスケア
NVR INC	—	0.2	72	8,152	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	37.5	82.5	477	53,742	エネルギー
PEPSICO INC	45.85	99.85	1,179	132,581	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	13	29	345	38,806	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5.5	13.5	117	13,163	公益事業
ACCENTURE PLC—CL A	20	42	669	75,311	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2	6	28	3,242	金融
PENTAIR PLC	5.75	10.25	74	8,400	資本財・サービス
QUALCOMM INC	46.5	99.5	649	73,029	情報技術
INVESCO LTD	16	25.5	94	10,667	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	3	5	55	6,212	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8.5	18	131	14,769	金融
RAYTHEON COMPANY	10	19.5	377	42,474	資本財・サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER—CL A	1	4.5	38	4,342	一般消費財・サービス
RED HAT INC	7	12.8	158	17,869	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	2.6	5	184	20,727	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	7	15	101	11,466	資本財・サービス
PRICELINE GROUP INC/THE	1.6	3.4	634	71,315	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	13.5	26	209	23,538	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	2.5	5.5	70	7,910	素材
RESMED INC	6	9.5	83	9,400	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	6	8.5	85	9,667	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	3	8	45	5,094	資本財・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	25.98	—	—	—	その他
RITE AID CORP	45	—	—	—	生活必需品
RALPH LAUREN CORP	1	4	41	4,722	一般消費財・サービス
AUTONATION INC	—	6.5	36	4,120	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	3	10.51	144	16,302	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	35.5	92.5	164	18,494	金融
CHEVRON CORP	59.5	129.5	1,655	186,164	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	9	23.5	149	16,785	公益事業
TESLA INC	4.5	9.3	310	34,896	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	20	39.5	114	12,885	情報技術
ENDO INTERNATIONAL PLC	3	—	—	—	ヘルスケア
STANLEY BLACK & DECKER INC	5.52	10.02	173	19,561	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	4	11	98	11,094	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC—A	6.53	13.23	469	52,778	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC — A	12	20	90	10,154	不動産
TWITTER INC	25	38	91	10,328	情報技術
SOUTHERN CO/THE	29	69	321	36,164	公益事業
SYSCO CORP	15	37	227	25,538	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	9	19	251	28,302	金融
SOUTHWESTERN ENERGY CO	7	—	—	—	エネルギー
SEI INVESTMENTS COMPANY	4	10	75	8,467	金融
STERICYCLE INC	2	5	35	3,942	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	—	13	58	6,594	素材
SCHLUMBERGER LTD	44.93	93.93	703	79,112	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4	10.5	55	6,186	資本財・サービス
AT&T INC	194.7	419.7	1,573	176,935	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	5	9	56	6,313	資本財・サービス
SHERWIN—WILLIAMS CO/THE	2.8	5.4	229	25,759	素材
SEMPRA ENERGY	8.5	17	182	20,573	公益事業
TIFFANY & CO	4.5	7.5	79	8,985	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	11	17	78	8,868	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	33	66.5	734	82,548	情報技術
SALESFORCE.COM INC	21	46	502	56,460	情報技術
SIGNET JEWELERS LTD	1	—	—	—	一般消費財・サービス
WESTROCK CO	7.12	17.12	115	12,975	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	27.53	60.53	234	26,375	資本財・サービス
ANDEAVOR	4.5	10.5	121	13,701	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	26.5	56.5	796	89,583	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	24	61	110	12,381	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	18.5	35.5	244	27,544	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	26	52.5	704	79,267	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE—CL B	21.5	49	632	71,140	資本財・サービス
UNUM GROUP	6	12	68	7,686	金融
SPRINT CORP	41.14	41.14	23	2,632	電気通信サービス
ANTERO RESOURCES CORP	—	10	19	2,183	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	3.53	9.53	93	10,560	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	5	11	58	6,554	金融
AMEREN CORPORATION	8	18.5	106	11,924	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	30	66.1	1,493	167,895	ヘルスケア
VERISIGN INC	1.5	7.5	84	9,527	情報技術
VALERO ENERGY CORP	15	30	282	31,744	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	2.3	3.3	76	8,643	一般消費財・サービス
FNF GROUP	11	17.5	71	8,034	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES—B	2	6	66	7,475	ヘルスケア
ANTHEM INC	8	18	422	47,497	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	48.5	105	1,154	129,808	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	149.87	321.87	2,003	225,345	金融
FOOT LOCKER INC	3	—	—	—	一般消費財・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	12.5	32	280	31,554	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	20	60	196	22,082	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5	10.5	83	9,385	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	2	5	84	9,466	一般消費財・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
WAL—MART STORES INC	60.0	102	1,023	115,146	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD—CL A	—	9	83	9,376	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7.5	15.5	192	21,646	ヘルスケア
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	17	—	—	—	エネルギー
WYNN RESORTS LTD	2	5	81	9,187	一般消費財・サービス
XEROX CORP	37.59	9.39	28	3,187	情報技術
WABTEC CORP	2	5	41	4,671	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	20.5	45.5	343	38,629	一般消費財・サービス
WATERS CORP	2.5	6.5	135	15,273	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	3.5	3.5	23	2,695	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	12.59	24.49	430	48,372	ヘルスケア
WHOLE FOODS MARKET INC	7	—	—	—	その他
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	28.5	61	447	50,362	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4.13	8.13	123	13,880	金融
WESTERN DIGITAL CORP	9.95	21.45	172	19,445	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	8.5	22	142	16,058	公益事業
WESTAR ENERGY INC	4	9	47	5,287	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	15	35	173	19,533	公益事業
VISA INC—CLASS A SHARES	59	127.5	1,518	170,772	情報技術
PPL CORP	18	46	144	16,206	公益事業
PULTEGROUP INC	7	19	65	7,403	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	9	17.1	202	22,732	素材
NORTHERN TRUST CORP	6.5	16	166	18,758	金融
VIDIA CORP	16	42.5	943	106,067	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	—	6	80	9,009	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15.03	33.03	488	54,903	金融
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q—A	18	29	76	8,547	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	12	46	5,270	資本財・サービス
TYSON FOODS INC—CL A	7.5	19.5	160	18,037	生活必需品
NETFLIX INC	13	30	627	70,610	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	12	27.5	566	63,733	ヘルスケア
TORCHMARK CORP	3.5	6.5	59	6,729	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5	9	79	8,926	金融
TREXTON INC	10	16	93	10,516	資本財・サービス
TWENTY—FIRST CENTURY FOX—A	37.5	78.5	286	32,255	一般消費財・サービス
TWENTY—FIRST CENTURY FOX — B	9	32	115	13,019	一般消費財・サービス
NEWS CORP — CLASS A	8	29	48	5,504	一般消費財・サービス
OGX ENERGY CORP	5	12	38	4,331	公益事業
OMNICOM GROUP	7.5	18.5	133	14,994	一般消費財・サービス
ORACLE CORP	99	217	1,064	119,714	情報技術
MASTERCARD INC — A	30	63.5	1,012	113,892	情報技術
ONEOK INC	5	22.5	127	14,292	エネルギー
CENTURYLINK INC	16.97	54.39	89	10,116	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	3.5	7.5	202	22,798	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	9.5	21	173	19,543	一般消費財・サービス
TAKE—TWO INTERACTIVE SOFTWARE	—	8	91	10,337	情報技術
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2.5	4	107	12,052	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO—B	6.5	12.5	104	11,755	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	10.5	37.5	117	13,186	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	322.63	682.63	2,066	232,357	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5	11	98	11,026	ヘルスケア
NORDSTROM INC	2	8	38	4,308	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	25	52.5	527	59,343	金融
ANALOG DEVICES INC	8	23.44	214	24,154	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	—	58	68	7,709	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	10	17.08	91	10,308	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32.2	61.7	374	42,066	金融
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	1	—	—	—	素材
ANADARKO PETROLEUM CORP	18	43	238	26,845	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7	12	120	13,585	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5.5	11	135	15,233	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	5	12	41	4,658	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	2	—	—	—	ヘルスケア
AVERY DENNISON CORP	3	6.5	77	8,691	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS—A	19.5	38	279	31,390	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	21	44.5	321	36,189	資本財・サービス
ACON PLC	8.5	17	232	26,174	金融
AMGEN INC	24	49	898	101,043	ヘルスケア
CORE LABORATORIES N.V.	1	—	—	—	エネルギー
TAPESTRY INC	12	18	81	9,179	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	15.12	30.62	251	28,227	資本財・サービス
CELGENE CORP	24.5	52.5	553	62,277	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC—A	6	11.5	255	28,718	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	33.5	77.1	422	47,563	情報技術
CIT GROUP INC	9	9	46	5,200	金融
CIMAREX ENERGY CO	2.5	8	102	11,479	エネルギー
CME GROUP INC	10	23	351	39,475	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	14.89	21.89	83	9,412	エネルギー
ECOLAB INC	8.5	17	232	26,124	素材
EQUIFAX INC	4.5	8.5	103	11,684	資本財・サービス
GAP INC/THE	3	13	41	4,676	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	41.5	90	702	79,041	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4.76	10.76	102	11,557	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	6	22	80	9,004	生活必需品
STATE STREET CORP	13	26.5	268	30,216	金融
STAPLES INC	8	—	—	—	その他
SUNTRUST BANKS INC	13.5	34	227	25,596	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	35.5	81	432	48,584	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	13	33.5	232	26,135	ヘルスケア
B/E AEROSPACE INC	2.5	—	—	—	その他
CAMPBELL SOUP CO	8	13	61	6,914	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	3	8	45	5,089	素材

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
CARDINAL HEALTH INC	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	ヘルスケア
FEDEX CORP	9.5	24.5	164	18,486	ヘルスケア
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	8.5	18	481	54,195	資本財・サービス
FMC CORP	15	33	335	37,735	金融
FLEX LTD	3	7.5	73	8,276	素材
CERNER CORP	10	45	84	9,457	情報技術
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9.5	18.5	132	14,915	ヘルスケア
CITRIX SYSTEMS INC	2	6.5	100	11,275	ヘルスケア
INTEL CORP	5.5	9.5	86	9,741	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	148.5	322.5	1,406	158,188	情報技術
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	17	28	56	6,394	一般消費財・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS	10.5	28.5	156	17,616	金融
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10	22.5	379	42,723	資本財・サービス
ILLUMINA INC	30	80	42	4,776	一般消費財・サービス
SEALED AIR CORP	5.5	11.1	269	30,306	ヘルスケア
INTUITIVE SURGICAL INC	8.5	14.5	71	7,984	素材
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1.3	7.5	298	33,532	ヘルスケア
SNAP-ON INC	6	8.5	87	9,864	情報技術
CALPINE CORP	1.5	3	53	6,030	資本財・サービス
CARMAX INC	12	-	-	-	公益事業
COMERICA INC	8	12	83	9,418	一般消費財・サービス
INGREDION INC	7	11	99	11,178	金融
DUKE ENERGY CORP	3	5.3	73	8,316	生活必需品
TARGET CORP	22.38	48.38	393	44,197	公益事業
DOVER CORP	17.5	37	255	28,766	一般消費財・サービス
WW GRAINGER INC	5.5	12	124	14,040	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2.5	4	94	10,673	資本財・サービス
CINTAS CORP	2	6	40	4,568	資本財・サービス
CA INC	3.5	5.5	88	9,971	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	6	22	74	8,351	情報技術
CLOXOR COMPANY	11	25	93	10,511	生活必需品
ENTERGY CORP	4.5	9	131	14,792	生活必需品
MICROSOFT CORP	4.5	11	88	9,910	公益事業
INCYTE CORP	232	506.5	4,468	502,465	情報技術
CVS HEALTH CORP	6	10.5	101	11,369	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	33	69.5	539	60,716	生活必需品
MICRON TECHNOLOGY INC	42.56	92.56	794	89,387	ヘルスケア
BLACKROCK INC	36	77.5	333	37,447	情報技術
CENTERPOINT ENERGY INC	3.8	8.1	432	48,633	金融
HASBRO INC	9	29	80	9,052	公益事業
KELLOGG CO	3	6	56	6,338	一般消費財・サービス
KEYCORP	7	18.5	127	14,308	生活必需品
KANSAS CITY SOUTHERN	40	71	147	16,558	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	2	7.5	82	9,316	資本財・サービス
KOHL'S CORP	52	103	442	49,792	生活必需品
COOPER COS INC/THE	7.5	8.5	48	5,450	一般消費財・サービス
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	1	3.5	81	9,219	ヘルスケア
APACHE CORP	23	23	30	3,395	金融
CHUBB LTD	14	25	111	12,524	エネルギー
ARROW ELECTRONICS INC	14.1	33.6	490	55,106	金融
ALLSTATE CORP	4.5	4.5	37	4,250	情報技術
EBAY INC	12.5	25	252	28,376	金融
PAYPAL HOLDINGS INC	34	66.5	262	29,560	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	34	81.5	645	72,575	情報技術
XILINX INC	6	9	87	9,844	素材
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	8	16.5	123	13,886	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	21.35	37.85	302	34,011	ヘルスケア
YAHOO! INC	6.5	15	72	8,192	一般消費財・サービス
ZIONS BANCORPORATION	28.5	-	-	-	その他
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	-	12	62	6,991	金融
TOLL BROTHERS INC	5.5	14.5	190	21,474	生活必需品
TRIMBLE INC	4	12	62	7,030	一般消費財・サービス
LINEAR TECHNOLOGY CORP	5	22	94	10,603	情報技術
LENNAR CORP-A	9	-	-	-	その他
LEAR CORP	8.5	14	93	10,495	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	2	4	75	8,518	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	7	23	120	13,570	金融
PRAXAIR INC	15.5	43.5	244	27,475	金融
PACCAR INC	8	20.5	333	37,547	素材
PVH CORP	11	23	172	19,353	資本財・サービス
BIOGEN INC	3.5	5.5	77	8,730	一般消費財・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	6.5	14.5	487	54,844	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	2	5.5	91	10,249	ヘルスケア
PERRIGO CO PLC	46.5	103.5	612	68,877	一般消費財・サービス
EVERSOURCE ENERGY	5	9	81	9,193	ヘルスケア
INTUIT INC	10	24	148	16,673	公益事業
BORGWARNER INC	8	16	263	29,659	情報技術
BEST BUY CO INC	9	15.5	86	9,715	一般消費財・サービス
BALL CORP	11	17	118	13,339	一般消費財・サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	5.46	18.92	72	8,191	素材
BED BATH & BEYOND INC	45.5	102.5	286	32,227	ヘルスケア
XL GROUP LTD	3	-	-	-	一般消費財・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	12	18.5	63	7,116	金融
VULCAN MATERIALS CO	10.5	22.5	252	28,382	情報技術
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3.5	10.5	140	15,838	素材
VF CORP	6.5	17.7	276	31,051	ヘルスケア
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	11	21	159	17,977	一般消費財・サービス
VIACOM INC-CLASS B	14	22	123	13,851	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	14	20	58	6,531	一般消費財・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	2.5	4.8	134	15,101	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5	-	-	-	情報技術
CARNIVAL CORP	3	6	67	7,619	ヘルスケア
	10	24.5	165	18,632	一般消費財・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
COMCAST CORP-CLASS A	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	一般消費財・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	75	318	1,291	145,217	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	-	11	43	4,913	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	10	15	93	10,503	資本財・サービス
AMERICA・ドル 株数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	9,721.77 594銘柄	20,843.96 600銘柄	164,975	18,551,533 <61.0%>	不動産
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	14	23	91	8,212	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	0.5	1.5	109	9,895	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9.38	9.38	29	2,678	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	8.21	14.21	110	9,987	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	9	22	57	5,207	素材
INTACT FINANCIAL CORP	3	10	103	9,315	金融
BCE INC	3	9	52	4,753	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	7	11	107	9,714	素材
SUNCOR ENERGY INC	61.12	118.12	555	50,059	エネルギー
METRO INC	6	16	66	6,010	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	10	23	146	13,206	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	43	82	679	61,273	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14	29	357	32,276	金融
TORONTO-DOMINION BANK	63	126	931	83,994	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	7	17	59	5,331	金融
ROYAL BANK OF CANADA	51	98	1,027	92,643	金融
TOURMALINE OIL CORP	13	13	27	2,452	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	4	4	19	1,713	エネルギー
TRANSCANADA CORP	27	57	347	31,377	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	18	37.71	169	15,263	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	47	192	56	5,107	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	47	83	150	13,576	素材
CAE INC	7	23	54	4,873	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	14.2	20.2	110	9,997	金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	26	-	-	-	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	-	18	44	4,018	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	-	6	49	4,449	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1	10	57	5,139	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	19	19	17	1,615	金融
LINAMAR CORP	-	6	44	4,045	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	11	11	19	1,745	エネルギー
HYDRO ONE LTD	15	15	33	2,994	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	9.89	14.89	101	9,111	生活必需品
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	10	36	3,282	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15	22	138	12,505	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	6	18	104	9,455	素材
KINROSS GOLD CORP	25.34	105.34	54	4,910	素材
BANK OF MONTREAL	22	46	471	42,477	金融
POWER CORP OF CANADA	16	31	99	9,000	金融
METHANEX CORP	6	6	45	4,139	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	-	5	68	6,219	情報技術
NUTRIEN LTD	-	43.27	284	25,633	素材
CAMECO CORP	4	28	32	2,941	エネルギー
TELUS CORP	3	3	13	1,259	電気通信サービス
POWER FINANCIAL CORP	10	20	68	6,183	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17	44	156	14,088	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3	5	83	7,551	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	80	80	33	3,051	素材
AGRIUM INC	6	-	-	-	その他
CANADIAN NATURAL RESOURCES	41	78	359	32,388	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	0.5	2	128	11,582	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	12	24	177	15,975	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	2	2	21	1,959	生活必需品
BLACKBERRY LTD	27	27	48	4,367	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	19	42	216	19,522	金融
ENBRIDGE INC	30	115	576	52,024	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	31	55	298	26,924	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	63	138	367	33,174	金融
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	-	20	59	5,368	ヘルスケア
GOLDCORP INC	26	63	106	9,577	素材
ENCANA CORP	44	69	117	10,583	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4	10	232	20,995	資本財・サービス
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	4	11	66	5,974	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4	14	56	5,106	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	25	53	554	50,041	資本財・サービス
CGI GROUP INC - CLASS A	7	13	87	7,857	情報技術
HUSKY ENERGY INC	6.12	30.12	55	5,000	エネルギー
ONEX CORPORATION	3	7	63	5,680	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	22	39	110	9,973	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	7	7	22	2,057	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	3	9	51	4,625	資本財・サービス
ELDORADO GOLD CORP	3	-	-	-	素材
IGM FINANCIAL INC	3	3	13	1,185	金融
OPEN TEXT CORP	3	14	58	5,318	情報技術
CI FINANCIAL CORP	6	20	58	5,298	金融
SAPUTO INC	6	13	56	5,123	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33	63	117	10,588	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	13	30	199	17,975	生活必需品
YAMANA GOLD INC	52	-	-	-	素材
FORTIS INC	13	30	134	12,118	公益事業
LUNDIN MINING CORP	-	66	55	5,022	素材
CRESCENT POINT ENERGY CORP	25	25	26	2,360	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	25	80	103	9,327	エネルギー
DOLLARAMA INC	2	9	139	12,538	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	-	8	35	3,173	公益事業

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	
ALTAGAS LTD	8	8	23	2,080	エネルギー
FIRST CAPITAL REALTY INC	—	20	42	3,814	不動産
KEYERA CORP	7	7	25	2,283	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	7	—	—	—	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	8	20	52	4,701	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	10	28	39	3,597	エネルギー
カナダ・ドル 株数・金額	1,396.26	2,877.74	12,443	1,122,012	
通貨計 銘柄数<比率>	82銘柄	86銘柄	—	< 3.7%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千ドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD	—	160	32	2,882	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD	93	228.24	73	6,458	金融
BHP BILLITON LIMITED	116	219.58	682	59,935	素材
SOUTH32 LTD	225	362.13	135	11,870	素材
LENDELEASE GROUP	20	—	—	—	不動産
ALUMINA LTD	121	121	30	2,690	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	20	57.74	200	17,582	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	48	105	55	4,899	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	8	36	42	3,758	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	87	172.43	510	44,883	金融
WESTPAC BANKING CORP	108.5	230.26	726	63,842	金融
SANTOS LTD	96	96	53	4,715	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	97	190.88	552	48,545	金融
RIO TINTO LTD	12	31.47	251	22,088	素材
ORIGIN ENERGY LTD	68	120.5	117	10,335	エネルギー
AMCOR LIMITED	51	74.96	113	9,980	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	85	153.11	74	6,511	資本財・サービス
OIL SEARCH LTD	32	84	67	5,949	エネルギー
SEEK LTD	26	26	50	4,398	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	26	55.92	86	7,558	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	22	58.04	134	11,828	素材
INCITEC PIVOT LTD	73	73	29	2,553	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	58	116.77	959	84,341	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	8	20	69	6,063	エネルギー
ORICA LTD	20	20	37	3,300	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	60	88	92	8,151	金融
CIMIC GROUP LTD	—	10	51	4,517	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	49	95.16	259	22,804	生活必需品
COCA—COLA AMATIL LTD	26	26	21	1,930	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	24	88	46	4,121	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	—	30	38	3,411	一般消費財・サービス
TELSTRA CORP LTD	136	351.14	131	11,571	電気通信サービス
AMP LTD	93.13	165.13	86	7,575	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES—CDI	12	32	71	6,290	素材
MACQUARIE GROUP LTD	12.31	21.13	215	18,944	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	20	40.35	91	8,035	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	30	30	38	3,364	金融
CSL LTD	15.5	31.02	440	38,682	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	35.75	69.85	310	27,291	生活必需品
COCHLEAR LTD	2	4.44	77	6,769	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	—	32.12	51	4,547	素材
SUNCORP GROUP LTD	39	99.38	137	12,052	金融
BORAL LTD	24	86	66	5,872	素材
ASX LTD	6	13	72	6,389	金融
COMPUTERSHARE LTD	9	37	60	5,309	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	57	175.18	126	11,084	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	8	25	58	5,162	ヘルスケア
TRANSURBAN GROUP	80.22	—	—	—	資本財・サービス
CHALLENGER LTD	25	25	35	3,082	金融
SYDNEY AIRPORT	38	—	—	—	資本財・サービス
TATTS GROUP LTD	80	—	—	—	一般消費財・サービス
AGL ENERGY LTD	25	40.5	99	8,744	公益事業
BRAMBLES LTD	45	113.37	113	9,992	資本財・サービス
APA GROUP	31	—	—	—	公益事業
DUJET GROUP	100	—	—	—	その他
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4	9	63	5,575	ヘルスケア
REA GROUP LTD	—	6.08	46	4,120	情報技術
DOMINOS PIZZA ENTERPRISES L	—	6.21	28	2,538	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル 株数・金額	2,607.41	4,563.08	8,021	704,909	
通貨計 銘柄数<比率>	52銘柄	52銘柄	—	< 2.3%>	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	60	90	603	8,671	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	60	170	1,037	14,924	一般消費財・サービス
MTR CORP	75	75	347	4,998	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	50	90	1,209	17,394	不動産
SINO LAND CO	120	340	498	7,167	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	100.52	195.52	1,940	27,904	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	40	80	260	3,750	不動産
SWIRE PACIFIC LTD — CL A	10	35	273	3,925	不動産
CLP HOLDINGS LTD	70	100	792	11,388	公益事業
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	40	—	—	—	資本財・サービス
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	36.9	95.59	511	7,354	不動産
HANG LUNG GROUP LTD	—	80	247	3,560	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	324.51	510.96	794	11,418	公益事業
HANG SENG BANK LTD	34	47	901	12,962	金融
WHEELLOCK & CO LTD	20	60	360	5,176	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	90	320	400	5,752	不動産
WH GROUP LTD	225	585	518	7,461	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	38	80	2,152	30,945	金融
MINTH GROUP LTD	—	60	289	4,167	一般消費財・サービス
LI & FUNG LTD	60	700	301	4,328	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	120	120	243	3,502	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	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	—	20	223	3,209	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HDG	10	80	242	3,491	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	—	150	218	3,136	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	—	75	273	3,936	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	20	86	291	4,198	金融
HJAN DEVELOPMENT CO	—	60	265	3,813	不動産
SJM HOLDINGS LTD	100	100	73	1,058	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	80	80	212	3,054	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	105.52	185.52	1,329	19,114	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	20	55	370	5,326	公益事業
PCCW LTD	—	600	286	4,124	電気通信サービス
AIA GROUP LTD	380	876	5,807	83,517	金融
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	—	320	262	3,773	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	—	140	742	10,669	不動産
SANDS CHINA LTD	102	166	694	9,989	一般消費財・サービス
SHANGRI—LA ASIA LTD	40	40	71	1,027	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	55	120	617	8,878	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	—	140	324	4,670	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	155	290	1,154	16,597	金融
WYNN MACAO LTD	60	60	145	2,092	一般消費財・サービス
HKT TRUST AND HKT LTD—SS	130	—	—	—	電気通信サービス
香港ドル 株数・金額	2,831.45	7,477.59	27,290	392,436	
通貨計 銘柄数<比率>	32銘柄	40銘柄	—	< 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	53	90	250	21,056	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	68	128	339	28,557	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	20	20	21	1,844	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	28	93	73	6,144	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	—	52	48	4,061	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	10	10	12	1,077	不動産
CAPITALAND LTD	70	190	71	6,044	不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	—	270	42	3,590	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	120	120	32	2,746	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	—	9	36	3,102	一般消費財・サービス
OVERSEA—CHINESE BANKING CORP	105	218	281	23,685	金融
GENTING SINGAPORE PLC	450	450	60	5,074	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	277	484	175	14,786	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	40	141	47	3,963	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	40	40	12	1,063	資本財・サービス
GOLDEN AGRI—RESOURCES LTD	90	90	3	291	生活必需品
SATS LTD	—	77	42	3,538	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	20	69	52	4,424	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	100	100	20	1,683	資本財・サービス
STARHUB LTD	120	120	34	2,918	電気通信サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	50	158	50	4,268	生活必需品
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	40	190	64	5,388	不動産
シンガポール・ドル 株数・金額	1,701	3,119	1,774	149,314	
通貨計 銘柄数<比率>	18銘柄	22銘柄	—	< 0.5%>	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	150	150	44	3,593	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	56	168.6	60	4,879	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	31	81	53	4,294	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	19	19	14	1,180	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	—	44.19	49	4,003	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル 株数・金額	256	462.79	223	17,951	
通貨計 銘柄数<比率>	4銘柄	5銘柄	—	< 0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT	50	50	17	2,712	一般消費財・サービス
TUI AG—DI	26	26	40	6,181	一般消費財・サービス
BP PLC	569	1,328.11	701	106,700	エネルギー
UNILEVER PLC	44.2	87.04	355	54,088	生活必需品
BARCLAYS PLC	537.5	1,202.18	242	36,914	金融
ROLLS—ROYCE HOLDINGS PLC	45.5	107.7	93	14,204	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	32	105	33	5,085	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	2	5	35	5,474	素材
PRUDENTIAL PLC	77.5	172.78	329	50,161	金融
INMARSAT PLC	12	—	—	—	電気通信サービス
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	151.7	236.79	66	10,106	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	3.3	10.3	33	5,046	素材
BAE SYSTEMS PLC	85	243	139	21,171	資本財・サービス
AVIVA PLC	140.54	273.06	140	21,447	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	156.5	349.92	471	71,708	ヘルスケア
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	—	31.33	68	10,492	情報技術
WORLDPAY GROUP PLC	57	135.17	60	9,195	情報技術
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	29	18	2,806	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	42	42	14	2,252	情報技術
DCC PLC	1.5	5	38	5,831	資本財・サービス
CONVATEC GROUP PLC	—	65.81	13	1,982	ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC	32.5	100.76	46	7,090	資本財・サービス
RELX PLC	37	66	111	17,012	資本財・サービス
DIAGEO PLC	79.5	172.54	458	69,834	生活必需品
RIO TINTO PLC	37.5	80.59	329	50,202	素材
STANDARD CHARTERED PLC	104	220.5	174	26,599	金融
TESCO PLC	237.5	591.54	126	19,297	生活必需品
FRESNILLO PLC	8	24	33	5,134	素材
SMITH & NEPHEW PLC	24	59.67	76	11,607	ヘルスケア
GLENCORE PLC	376.5	805.44	320	48,801	素材
WOOD GROUP (JOHN) PLC	—	54.66	37	5,707	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15	15	27	4,144	金融
SMITHS GROUP PLC	9	22.6	34	5,304	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
BABCOCK INTL GROUP PLC	百株	百株	千円	千円	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	6	109.63	40	6,222	金融
DIXONS CARPHONE PLC	47	—	—	—	一般消費財・サービス
PEARSON PLC	15	43	31	4,829	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	68.5	68.5	17	2,589	生活必需品
NEXT PLC	6	11.59	58	8,852	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	40	170	35	5,403	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	4	9.5	37	5,699	一般消費財・サービス
IMI PLC	4.75	24.1	33	5,122	資本財・サービス
BUNZL PLC	9	19	38	5,848	資本財・サービス
GKN PLC	26	92	30	4,611	一般消費財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	778.45	1,831.14	435	66,313	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	1.93	8.03	36	5,512	素材
KINGFISHER PLC	97	172.29	58	8,936	一般消費財・サービス
WPP PLC	40.5	99.21	132	20,228	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	14.4	36.9	28	4,391	公益事業
SEVERN TRENT PLC	13	13	26	4,080	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	18.3	48.18	329	50,203	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	27	27	33	5,157	金融
SCHRÖDERS PLC	5.5	5.5	19	3,037	金融
TATE & LYLE PLC	20	—	—	—	生活必需品
SSE PLC	32	61.06	79	12,171	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE BARRATT DEVELOPMENTS PLC	13	13	29	4,529	資本財・サービス
ASTRAZENECA PLC	39	86.08	444	67,637	ヘルスケア
FERGUSON PLC	6.73	16	87	13,375	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	230.5	399.29	108	16,470	金融
3I GROUP PLC	28	57.37	52	8,020	金融
SKY PLC	41	63	64	9,758	一般消費財・サービス
ASHTON GROUP PLC	12	39	79	12,153	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE NATIONAL GRID PLC	23.79	58.79	47	7,202	情報技術
LOYDYS BANKING GROUP PLC	107.5	228.11	194	29,527	公益事業
RSA INSURANCE GROUP PLC	2,157.78	5,124.1	350	53,330	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	23.8	61.07	193	29,484	生活必需品
CENTRICA PLC	29.5	61.07	193	29,484	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE PROVIDENT FINANCIAL PLC	168	380.02	53	8,176	公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	7	7	29	4,516	一般消費財・サービス
BHP BILLITON PLC	5.5	—	—	—	金融
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	57.55	160.83	797	121,368	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	65	135.12	217	33,031	金融
SHIRE PLC	10.5	29.6	84	12,800	生活必需品
OLD MUTUAL PLC	620.5	1,400.19	1,072	163,262	金融
ANGLO AMERICAN PLC	26.22	64.38	238	36,328	ヘルスケア
MONDI PLC	197.12	307.12	69	10,617	金融
VIM MORRISON SUPERMARKETS	54	91.68	153	23,394	素材
CARNIVAL PLC	19	34	65	9,976	素材
EASYJET PLC	57	145	33	5,125	生活必需品
COMPASS GROUP PLC	4	13.83	68	10,353	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	—	16.44	24	3,771	資本財・サービス
BT GROUP PLC	53.08	105.61	163	24,932	一般消費財・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	16	25.69	69	10,612	一般消費財・サービス
BURBERRY GROUP PLC	276	557.73	152	23,218	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	—	12	28	4,345	生活必需品
CAPITA PLC	21	33	58	8,922	一般消費財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC	2.94	13.72	64	9,799	一般消費財・サービス
INTEK GROUP PLC	11	49	20	3,047	資本財・サービス
ITV PLC	3	17	26	4,052	資本財・サービス
PETROFAC LTD	3	10	52	8,024	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	151.5	275.87	46	7,125	一般消費財・サービス
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	9	—	—	—	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	13.5	20.35	75	11,515	金融
MEGGITT PLC	133	313.55	794	120,944	エネルギー
G4S PLC	120.27	254.47	653	99,472	エネルギー
COBHAM PLC	35	35	17	2,621	資本財・サービス
ADMIRAL GROUP PLC	32	113.2	32	4,917	資本財・サービス
INVESTEC PLC	34	196.77	23	3,649	資本財・サービス
ANTOFAGASTA PLC	4	15.7	29	4,564	金融
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	9	46	24	3,733	金融
EXPERIAN PLC	7	34.6	34	5,264	素材
イギリス・ポンド	9,386.44	21,017.95	13,398	2,038,778	資本財・サービス
通貨計	98銘柄	99銘柄	—	—	株数、金額
					銘柄数<比率>
(イスラエル)	株数、金額	株数	株数	株数	株数、金額
通貨計	137	257.48	903	29,512	銘柄数<比率>
	5銘柄	7銘柄	—	—	
(スイス)	株数、金額	株数	株数	株数	株数、金額
通貨計	137	257.48	903	29,512	銘柄数<比率>
	5銘柄	7銘柄	—	—	

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	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	百株	百株	千円	千円	生活必需品
ABB LTD - REG	—	0.01	71	8,115	資本財・サービス
ARYZTA AG	68	131.26	355	40,613	資本財・サービス
SWISS RE AG	2	—	—	—	生活必需品
NESTLE SA-REG	11.5	20.5	188	21,547	金融
PARTNERS GROUP HOLDING AG	106	217	1,831	209,338	生活必需品
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	0.5	1.63	112	12,883	金融
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1.5	3	70	8,058	資本財・サービス
JULIUS BAER GROUP LTD	72.31	185.03	329	37,687	金融
SGS SA-REG	5	15.65	97	11,169	金融
VIFOR PHARMA AG	0.17	0.32	83	9,546	資本財・サービス
SWATCH GROUP AG/THE- BR	0.12	3.69	50	5,807	ヘルスケア
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1	1.8	74	8,464	一般消費財・サービス
BALOISE HOLDING AG - REG	5.3	10.63	328	37,507	金融
CLARIANT AG-REG	1	3.2	49	5,705	金融
NOVARTIS AG-REG	—	15.68	43	5,009	素材
BARRY CALLEBAUT AG-REG	75.3	153.52	1,304	149,082	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	—	0.2	41	4,686	生活必需品
SWISSCOM AG-REG	16.5	39.17	351	40,231	一般消費財・サービス
GEBERIT AG-REG	1.2	1.8	95	10,916	電気通信サービス
GIVAUDAN-REG	1	2.34	101	11,610	資本財・サービス
ACTELION LTD-REG	0.35	0.68	154	17,658	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4	—	—	—	その他
SYNGENTA AG-REG	—	0.52	37	4,264	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	3.4	—	—	—	素材
LONZA GROUP AG-REG	1	3	47	5,378	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	2.5	5.42	146	16,788	ヘルスケア
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	16.7	31.17	184	21,034	一般消費財・サービス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1.5	2.31	81	9,280	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1	3	54	6,213	資本財・サービス
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	4.5	4.5	40	4,680	不動産
スイス・フラン	0.03	0.1	60	6,869	生活必需品
通貨計	55,858	1,180.73	8,443	965,105	
	33銘柄	36銘柄	—	—	株数、金額
(デンマーク)	銘柄数<比率>	銘柄数	銘柄数	銘柄数	銘柄数、金額
通貨計	155,86	398.18	12,687	228,622	銘柄数<比率>
	15銘柄	18銘柄	—	—	
(ノルウェー)	株数、金額	株数	株数	株数	株数、金額
通貨計	155,86	398.18	12,687	228,622	銘柄数<比率>
	15銘柄	18銘柄	—	—	
(スウェーデン)	株数、金額	株数	株数	株数	株数、金額
通貨計	155,86	398.18	12,687	228,622	銘柄数<比率>
	15銘柄	18銘柄	—	—	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ATLAS COPCO AB-B SHS	16	25	834	11,387	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	41	67.9	1,200	16,381	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	-	4.74	304	4,160	金融
LUNDIN PETROLEUM AB	8	19	385	5,259	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	-	50.5	1,188	16,226	生活必需品
BOLIDEN AB	8	18	539	7,366	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	24	24	196	2,678	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB-B	5	15	434	5,933	金融
HEXAGON AB-B SHS	10	17	728	9,941	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	13	278	3,797	金融
スウェーデン・クロス 通貨計	株数、金額 29銘柄	株数、金額 31銘柄	24,446	333,693	< 1.1% >
ユーロ (アイルランド)	株数	株数	千ユーロ	千円	業種
AIB GROUP PLC	-	90	49	6,582	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,570	52.34	39	5,274	金融
KERRY GROUP PLC-A	5.5	12.66	115	15,484	生活必需品
CRH PLC	26.5	50.5	158	21,237	素材
PADDY POWER BETFAIR PLC	2	4.6	46	6,197	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 4銘柄	株数、金額 5銘柄	408	54,776	< 0.2% >
ユーロ (オランダ)	株数	株数	千ユーロ	千円	業種
QIAGEN N.V.	4	12.99	35	4,711	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	32.5	59.5	197	26,523	ヘルスケア
NN GROUP NV	7	22.5	83	11,267	金融
UNILEVER NV-CVA	47	112.44	528	70,952	生活必需品
HEINEKEN NV	8.6	18.65	167	22,468	生活必需品
RELX NV	32.45	64	121	16,274	資本財・サービス
AEGON NV	86	143.61	79	10,668	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	37.24	88.76	161	21,737	生活必需品
AKZO NOBEL	10	17.25	129	17,346	素材
KONINKLIJKE DSM NV	6	14.59	120	16,152	素材
WOLTERS KLUWER	9.5	23.76	106	14,251	資本財・サービス
BOSKALIS WESTMINSTER	1	9.1	28	3,883	資本財・サービス
ING GROEP NV	115	264.15	421	56,572	金融
KONINKLIJKE KPN NV	56	239	69	9,300	電気通信サービス
ASML HOLDING NV	12.4	25.27	387	52,000	情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA	13	24	66	8,908	金融
VOPAK	-	6.3	23	3,115	エネルギー
RANDSTAD HOLDING NV	3	7.5	42	5,648	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	2	6	51	6,851	生活必需品
GEMALTO	2	-	-	-	情報技術
ALTICE NV-A	13.5	33.5	34	4,693	一般消費財・サービス
ALTICE NV-B	1	-	-	-	一般消費財・サービス
AIRBUS SE	17.5	39.97	347	46,598	資本財・サービス
EXOR NV	4.5	10.88	64	8,592	金融
CNH INDUSTRIAL NV	46.5	73.53	87	11,791	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	42	70.44	130	17,458	一般消費財・サービス
FERRARI NV	4.5	8.3	79	10,681	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 26銘柄	株数、金額 25銘柄	3,565	478,450	< 1.6% >
ユーロ (ベルギー)	株数	株数	千ユーロ	千円	業種
UCB SA	3	7	48	6,481	ヘルスケア
KBC GROEP NV	9.5	17.34	127	17,079	金融
COLRUYT SA	3.5	3.5	15	2,073	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4	4	37	5,070	金融
SOLVAY SA	3	5.36	64	8,602	素材
UMICORE	2	16	70	9,440	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	24.2	53.07	508	68,173	生活必需品
AGEAS	3	16.54	69	9,368	金融
PROXIMUS	7	7	19	2,624	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	-	4.62	28	3,797	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 9銘柄	株数、金額 10銘柄	988	132,711	< 0.4% >
ユーロ (ルクセンブルグ)	株数	株数	千ユーロ	千円	業種
RTL GROUP	-	3.5	24	3,268	一般消費財・サービス
ARCELORMITTAL	56	43.44	129	17,341	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	0.6	0.6	31	4,291	ヘルスケア
SES	19	19	24	3,343	一般消費財・サービス
TENARIS SA	22	22	30	4,053	エネルギー
国小計	株数、金額 4銘柄	株数、金額 5銘柄	240	32,299	< 0.1% >
ユーロ (フランス)	株数	株数	千ユーロ	千円	業種
JCDECAUX SA	-	8.45	30	4,070	一般消費財・サービス
TOTAL SA	67.5	152.31	735	98,717	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	6.5	11.5	149	20,030	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	12.79	28.45	312	41,956	素材
KERING	3.2	5.12	206	27,715	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	19	38.93	289	38,908	資本財・サービス
BOUYGUES SA	5	12.5	56	7,517	資本財・サービス
BNP PARIBAS	34.5	76.75	502	67,386	金融
PEUGEOT SA	11	45.73	83	11,146	一般消費財・サービス
NATIXIS	30	76.74	53	7,202	金融
THALES SA	3	6	54	7,339	資本財・サービス
DANONE	18.5	39.26	279	37,494	生活必需品
CARREFOUR SA	22	51.56	91	12,332	生活必需品
SUEZ	9.5	29.5	42	5,763	公益事業
VIVENDI	27.46	69.25	171	23,045	一般消費財・サービス
L'OREAL	7.9	17.28	325	43,663	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	16.5	32.89	159	21,423	資本財・サービス
LEGRAND SA	8.5	17.5	115	15,508	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	2	2	10	1,384	生活必需品

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
PERNOD RICARD SA	8.1	15.58	207	27,889	生活必需品
SOCIETE BIC SA	1.5	1.5	14	1,912	資本財・サービス
EURAZEO SA	5	1.59	13	1,753	金融
REXEL SA	16	16	24	3,325	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA	23.5	54.11	244	32,801	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9.3	18.41	453	60,797	一般消費財・サービス
ACCOR SA	3	10	45	6,045	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	6	12.71	132	17,805	情報技術
VALEO SA	6.5	15.12	100	13,443	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	5	13	74	9,939	資本財・サービス
BUREAU VERITAS SA	4	17	40	5,470	資本財・サービス
EIFFAGE	4	4	37	5,080	資本財・サービス
SODEXO SA	2	6.69	73	9,852	一般消費財・サービス
IPSEN	-	2.76	29	3,933	ヘルスケア
INGENICO GROUP	2	4.99	46	6,191	情報技術
AMUNDI SA	-	4.37	31	4,245	金融
TELEPERFORMANCE	-	5	63	8,554	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	-	5	34	4,687	情報技術
ZODIAC AEROSPACE	8	21.34	53	7,150	資本財・サービス
FAURECIA	-	5.6	39	5,317	一般消費財・サービス
SEB SA	-	1.97	33	4,430	一般消費財・サービス
ESSILOR INTERNATIONAL	7	14.86	169	22,792	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA	-	0.22	30	4,029	資本財・サービス
AXA SA	57.5	123.65	321	43,198	金融
CHRISTIAN DIOR SE	2.5	-	-	-	一般消費財・サービス
LAGARDERE SCA	-	12	31	4,280	一般消費財・サービス
TECHNIP SA	2	-	-	-	その他
EDENRED	8	19.13	47	6,371	資本財・サービス
RENAULT SA	6	12	107	14,421	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	0.82	2.04	91	12,288	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	-	2.53	28	3,863	生活必需品
ATOS SE	2	6.43	80	10,863	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA	6	8.99	82	11,026	情報技術
WENDEL	-	2.01	29	3,951	金融
ORANGE	66.5	121.29	178	23,949	電気通信サービス
ALSTOM	3.1	13.1	47	6,319	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	-	13.49	27	3,649	金融
SANOFI	36	72.79	540	72,515	ヘルスケア
VINCI SA	17	31.06	275	36,911	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	25	38.63	84	11,367	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	38.5	76.58	114	15,301	金融
BIOMERIEUX	-	4.57	36	4,875	ヘルスケア
ENGIE	56.39	123.26	180	24,281	公益事業
IMERYS SA	-	3.4	28	3,823	素材
EDF	-	34	36	4,852	公益事業
SAFRAN SA	11.5	22.2	199	26,721	資本財・サービス
ILIAD SA	1	2.19	45	6,159	電気通信サービス
ARKEMA	2	4.8	50	6,734	素材
ADP	1	1	16	2,196	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	-	14	25	3,481	一般消費財・サービス
SCOR SE	6	12.97	45	6,121	金融
GETLINK	11	39.4	43	5,879	資本財・サービス
BOLLORE	-	73	34	4,690	資本財・サービス
国小計	株数、金額 55銘柄	株数、金額 70銘柄	8,496	1,140,157	< 3.8% >
ユーロ (ドイツ)	株数	株数	千ユーロ	千円	業種
BAYER AG-REG	25	53.6	574	77,104	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	6	6	19	2,569	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	48.5	136.93	206	27,764	金融
COMMERZBANK AG	49.9	72.89	91	12,333	金融
VOLKSWAGEN AG	0.5	2.2	39	5,337	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	6	11.72	211	28,346	一般消費財・サービス
MAN SE	1	1	9	1,289	資本財・サービス
SIEMENS AG-REG	24	49.62	603	80,967	資本財・サービス
E.ON SE	55.5	162.7	146	19,684	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	11	23.9	215	28,928	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	5.5	13	53	7,161	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG	1.45	6.45	50	6,799	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	3.3	7.5	188	25,291	一般消費財・サービス
BASF SE	28.4	60.62	574	77,034	素材
LINDE AG	7	-	-	-	素材
K+S AG-REG	3	14	30	4,146	素材
ALLIANZ SE-REG	14.6	30.61	613	82,335	金融
THYSSENKRUPP AG	15.5	26.3	65	8,826	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7	14.05	161	21,691	生活必需品
RWE AG	16.5	33.07	58	7,859	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	-	17	51	6,866	資本財・サービス
FRAPOORT AG FRANKFURT AIRPORT	-	1.1	10	1,394	資本財・サービス
BRENNTAG AG	8	14.36	78	10,567	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	11	30.86	207	27,861	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4	9.59	56	7,638	情報技術
HOCHTIEF AG	-	1.66	24	3,283	資本財・サービス
SAP SE	28.5	64.24	612	82,246	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4.5	10.36	193	25,948	金融
SCHAEFFLER AG	-	21.02	32	4,315	一般消費財・サービス
ZALANDO SE	-	7	31	4,180	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	6	9	84	11,371	素材
KION GROUP AG	-	6	46	6,210	資本財・サービス
WIRECARD AG	-	10	105	14,089	情報技術
COVESTRO AG	4	8.03	70	9,516	素材
INNOVY SE	6	6	19	2,677	公益事業
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	8	12.65	95	12,856	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
		外貨建金額	外貨換算金額		
METRO AG	百株	百株	千ユーロ	千円	生活必需品
DRILLISCH AG	-	15	25	3,462	電気通信サービス
LINDE AG - TENDER	-	5	36	4,834	電気通信サービス
BEIERSDORF AG	-	13.3	281	37,836	素材
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5	8.15	81	10,941	生活必需品
MERCK KGAA	-	7	31	4,211	素材
ADIDAS AG	5.7	8.12	76	10,209	ヘルスケア
HENKEL AG & CO KGAA	6.2	12.57	212	28,531	一般消費財・サービス
CECONOMY AG	4	6.5	67	9,097	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	5	-	-	-	一般消費財・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	95	211.13	316	42,454	電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	7.5	17.66	162	21,811	ヘルスケア
HANNOVER RUECK SE	31.1	66.01	489	65,690	一般消費財・サービス
DEUTSCHE POST AG-REG	41	84.23	209	28,177	情報技術
DEUTSCHE BOERSE AG	1	3.5	37	5,091	金融
DEUTSCHE BOERSE AG	27	66.98	272	36,554	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	-	12.74	126	16,993	金融
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	7	-	-	-	その他
LANXESS AG	9	15.6	45	6,160	一般消費財・サービス
MTU AERO ENGINES AG	2	6	41	5,618	素材
AXEL SPRINGER SE	4	4	62	8,373	資本財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	-	4.7	31	4,282	一般消費財・サービス
SYMRISE AG	15.8	23.63	89	12,024	不動産
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	4	8.3	59	7,996	素材
BAYERISCHES MOTOREN WERKE -PRF	-	6.24	26	3,560	電気通信サービス
HUGO BOSS AG -ORD	2.5	2.5	19	2,584	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	3.5	3.5	25	3,426	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	11.5	35.6	150	20,231	不動産
国小計	株数、金額	株数	株数	株数	株数
	693.45	1,659.15	8,619	1,156,656	1,156,656
	48銘柄	60銘柄	<3.8%>	<3.8%>	<3.8%>
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	8	8	13	1,802	公益事業
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	57	151	44	5,981	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	18	36.09	57	7,673	エネルギー
国小計	株数、金額	株数	株数	株数	株数
	83	195.09	115	15,458	15,458
	3銘柄	3銘柄	<0.1%>	<0.1%>	<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	148	325.71	272	36,595	電気通信サービス
ENDESA SA	9	21.5	39	5,279	公益事業
BANCO POPULAR ESPANOL	32.41	-	-	-	金融
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTIA	197.89	424.92	308	41,407	金融
IBERDROLA SA	156.06	368.4	243	32,647	公益事業
BANCO DE SABADELL SA	145.87	325.87	58	7,842	金融
BANKINTER SA	27	67	54	7,331	金融
REPSOL SA	28	83.17	131	17,628	エネルギー
GRIFOLS SA	4	17	45	6,056	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	428.5	1,025.73	584	78,483	金融
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	32.6	48.29	90	12,163	資本財・サービス
AMADEUS IT GROUP SA	14	31.95	203	27,301	情報技術
GAS NATURAL SDG SA	6	21	43	5,776	公益事業
MAPFRE SA	-	80.05	22	3,050	金融
CAIXABANK S.A	143.87	219.87	91	12,223	金融
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	49	49	36	4,955	資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	3	21.95	74	9,967	資本財・サービス
AENA SAME SA	2	4	71	9,616	資本財・サービス
MASMOVIL IBERCOM SA	156.06	-	-	-	電気通信サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	37.5	69.28	205	27,518	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	-	17.93	22	2,960	資本財・サービス
ENAGAS SA	8	18.59	44	6,019	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23	40.56	74	10,063	公益事業
FERROVIAL SA	26	38.76	76	10,207	資本財・サービス
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	32	-	-	-	生活必需品
BANKIA SA	50	72.87	29	4,021	金融
国小計	株数、金額	株数	株数	株数	株数
	1,759.76	3,393.4	2,825	379,119	379,119
	24銘柄	23銘柄	<1.2%>	<1.2%>	<1.2%>
ユーロ (イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	金融
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	-	130	25	3,485	金融
PRYSMIAN SPA	4	14.4	41	5,557	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	40.11	96.36	148	19,913	金融
MEDIOBANCA SPA	11.6	44.6	42	5,730	金融
UNICREDIT SPA	149.33	141.35	232	31,258	金融
TELECOM ITALIA SPA	298	1,085.03	81	10,949	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP	97	483.81	30	4,070	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO-RSP	-	93.84	25	3,465	金融
INTESA SANPAOLO	399.5	837.01	237	31,898	金融
ATLANTIA SPA	14.77	35.27	95	12,807	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	29	29	18	2,510	金融
RECORDATI SPA	-	6.92	26	3,593	ヘルスケア
ENI SPA	72	163.64	237	31,840	エネルギー
LEONARDO SPA	5	25	27	3,626	資本財・サービス
ENEL SPA	248	562.64	299	40,204	公益事業
SNAM SPA	89	162	67	9,004	エネルギー
LUXOTTICA GROUP SPA	8	13.07	67	9,058	一般消費財・サービス
TERNI SPA	37	99	48	6,568	公益事業
国小計	株数、金額	株数	株数	株数	株数
	1,502.31	4,022.94	1,755	235,541	235,541
	15銘柄	18銘柄	<0.8%>	<0.8%>	<0.8%>
ユーロ (フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	素材
UPM-KYMMENE OYJ	20.5	44.93	118	15,965	素材

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
		外貨建金額	外貨換算金額		
NOKIA OYJ	百株	百株	千ユーロ	千円	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	161	364.94	149	20,112	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	3	8.5	46	6,239	資本財・サービス
METSO OYJ	20	41.93	57	7,759	素材
ELISA OYJ	3	11.08	32	4,424	資本財・サービス
SAMPO OYJ-A SHS	2.5	13	42	5,768	電気通信サービス
FORTUM OYJ	11	29.29	137	18,437	金融
KONE OYJ-B	7	24	41	5,528	公益事業
NOKIAN RENKAAT OYJ	13	26.6	124	16,680	資本財・サービス
NESTE OYJ	7	7	27	3,679	一般消費財・サービス
ORION OYJ-CLASS B	4	11	59	8,018	エネルギー
国小計	株数、金額	株数	株数	株数	株数
	257	587.27	855	114,766	114,766
	12銘柄	12銘柄	<0.4%>	<0.4%>	<0.4%>
ユーロ (オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	エネルギー
OMV AG	6	12.09	66	8,861	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	10.5	20	75	10,187	金融
VOESTALPINE AG	8	8	42	5,676	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	-	11	35	4,795	金融
ANDRITZ AG	-	5.5	26	3,527	資本財・サービス
国小計	株数、金額	株数	株数	株数	株数
	24.5	56.59	246	33,049	33,049
	3銘柄	5銘柄	<0.1%>	<0.1%>	<0.1%>
ユーロ (その他)	百株	百株	千ユーロ	千円	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5	-	-	-	生活必需品
STMICROELECTRONICS NV	12	49.17	96	13,004	情報技術
国小計	株数、金額	株数	株数	株数	株数
	17	49.17	96	13,004	13,004
	2銘柄	1銘柄	<0.0%>	<0.0%>	<0.0%>
ユーロ通貨計	株数、金額	株数	株数	株数	株数
	7,487.57	13,656.72	28,213	3,785,992	3,785,992
	205銘柄	237銘柄	<12.5%>	<12.5%>	<12.5%>
ファンド合計	株数、金額	株数	株数	株数	株数
	37,223.84	77,886.52	-	28,401.653	28,401.653
	1,175銘柄	1,242銘柄	<9.34%>	<9.34%>	<9.34%>

(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中値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
 (注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
 (注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託受益証券

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
		外貨建金額	外貨換算金額		
(シンガポール)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	-	70	29	3,306	
アメリカ・ドル 通貨計	口数、金額	口数	口数	口数	口数
	-	-	70	29	3,306
	銘柄数<比率>	銘柄数	銘柄数	銘柄数	銘柄数
	-	-	1銘柄	-	<0.0%>

(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中値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
 (注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
 (注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託証券

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
		外貨建金額	外貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.372	0.872	150	16,970	
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.934	2.094	346	38,977	
BOSTON PROPERTIES INC	0.55	1.15	144	16,216	
GGP INC	1.7	4	92	10,453	
VORNADO REALTY TRUST	0.606	1.156	85	9,584	
SBA COMMUNICATIONS CORP	-	0.8	130	14,712	
EQUITY RESIDENTIAL	1	2.25	140	15,775	
EQUINIX INC	0.234	0.514	234	26,355	
AMERICAN TOWER CORP	1.3	3.1	437	49,169	
HOST HOTELS & RESORTS INC	2.728	4.228	86	9,717	
KIMCO REALTY CORP	1.8	3.3	56	6,390	
PARK HOTELS & RESORTS INC	0.35	-	-	-	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	-	3.5	38	4,325	
INVITATION HOMES INC	-	2.2	50	5,645	
VENTAS INC	1.25	2.7	155	17,515	
WEYERHAEUSER CO	2.504	4.904	172	19,444	
AGNC INVESTMENT CORP	0.7	2.1	41	4,670	
BRIMMOR PROPERTY GROUP INC	1.4	1.4	24	2,717	
CROWN CASTLE INTL CORP	1.15	2.8	301	33,904	
IRON MOUNTAIN INC	0.918	1.718	63	7,115	
VEREIT INC	4.35	7.75	58	6,527	
PROLOGIS INC	1.465	3.415	213	24,058	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.2	0.7	88	9,943	
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.3	0.65	57	6,450	
DUKE REALTY CORP	0.8	3.1	81	9,143	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.25	0.45	106	11,955	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.25	0.45	56	6,347	
WELLTOWER INC	1.2	2.35	144	16,217	
HCP INC	1.2	2.8	68	7,714	
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.3	1	41	4,709	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.45	0.7	66	7,478	
MACERICH CO/THE	0.3	0.7	44	5,001	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	3.7	9.6	110	12,425	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	0.65	0.65	26	3,000	

銘柄	期首		当期		期末	
	口数	口数	外貨建金額	外貨建金額	邦貨換算金額	邦貨換算金額
REALTY INCOME CORP	千口	千口	千アメリカ・ドル	千口	千円	千円
PUBLIC STORAGE	0.95	1.8	97	10,980		
REGENCY CENTERS CORP	0.45	1.1	221	24,881		
SL GREEN REALTY CORP	0.3	1.15	75	8,522		
UDR INC	0.4	0.65	64	7,209		
DIGITAL REALTY TRUST INC	1.2	1.9	70	7,892		
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.55	1.45	163	18,359		
アメリカ・ドル 通貨計	39,261 38銘柄	87,951 40銘柄	4,677	525,956		<1.7%>
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円		
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	-	2	42	3,862		
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	-	1.4	34	3,096		
カナダ・ドル 通貨計	- -	3.4 2銘柄	77	6,959		<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		
LENDLEASE GROUP	-	4,303	69	6,095		
TRANSURBAN GROUP	-	17,162	211	18,550		
SYDNEY AIRPORT	-	9,129	64	5,679		
APA GROUP	-	7.5	61	5,424		
SCENTRE GROUP	22.429	30,929	128	11,334		
DEXUS	2.5	6.5	66	5,815		
GPT GROUP	6.82	14,648	76	6,719		
MIRVAC GROUP	13.9	31,638	73	6,478		
STOCKLAND	6.1	14.3	63	5,579		
WESTFIELD CORP	5.6	13,956	130	11,467		
GOODMAN GROUP	8.8	14,731	124	10,900		
VICINITY CENTRES	19.523	19,523	53	4,666		
オーストラリア・ドル 通貨計	85.672 8銘柄	184,319 12銘柄	1,123	98,711		<0.3%>
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円		
LINK REIT	9.5	13.5	1,002	14,414		
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	-	34	344	4,947		
香港ドル 通貨計	9.5 1銘柄	47.5 2銘柄	1,346	19,362		<0.1%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	-	28	55	4,665		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	12	12	33	2,807		
CAPITALAND MALL TRUST	9	9	18	1,590		
SUNTEC REIT	-	26	57	4,813		
シンガポール・ドル 通貨計	21 2銘柄	75 4銘柄	164	13,877		<0.0%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円		
LAND SECURITIES GROUP PLC	3.05	4,808	47	7,293		
SEGRO PLC	1.52	5,92	34	5,291		
HAMMERSON PLC	1.2	4.9	26	3,973		
BRITISH LAND CO PLC	2.3	6.3	43	6,572		
イギリス・ポンド 通貨計	8.07 4銘柄	21,928 4銘柄	152	23,131		<0.1%>
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円		
UNIBAIL-RODAMCO SE	0.37	0.609	128	17,292		
ICADE	-	0.406	33	4,551		
GECINA SA	0.14	0.334	52	7,009		
KLEPIERRE	0.6	1.4	50	6,812		
FONCIERE DES REGIONS	-	0.353	32	4,417		
ユーロ通貨計	1.11 3銘柄	3,102 5銘柄	298	40,083		<0.1%>
合計	164,613 56銘柄	423,269 69銘柄	-	728,082		<2.4%>

(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。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期		期末	
	買建額	売建額	買建額	売建額
外	百万円	百万円		
S&P500 E-MINI FUTURE (アメリカ)	789	-		
S&P/TSE 60 INDEX (カナダ)	52	-		
SPI 200 INDEX (オーストラリア)	40	-		
FT 100 (イギリス)	105	-		
国				
SMI (スイス)	21	-		
EURO STOXX 50 (ドイツ)	189	-		

(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

2018年1月10日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	28,401,653	92.4%
投資信託受益証券	3,306	0.0%
投資信託証券	728,082	2.4%
コール・ローン等、その他	1,588,474	5.2%
投資信託財産総額	30,721,516	100.0%

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、1月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.45円、1カナダ・ドル=90.17円、1オーストラリア・ドル=87.88円、1香港ドル=14.38円、1シンガポール・ドル=84.16円、1ニュージーランド・ドル=80.39円、1イギリス・ポンド=152.16円、1イスラエル・シェケル=32.66円、1スイス・フラン=114.30円、1デンマーク・クローネ=18.02円、1ノルウェー・クローネ=13.86円、1スウェーデン・クローネ=13.65円、1ユーロ=134.19円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産 (29,642,904千円) の投資信託財産総額 (30,721,516千円) に対する比率は、96.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年1月10日現在

項目	当期末
(A) 資産	59,632,658,949円
コール・ローン等	1,146,491,788
株式(評価額)	28,401,653,925
投資信託受益証券(評価額)	3,306,030
投資信託証券(評価額)	728,082,636
未収入金	29,037,668,856
未収配当金	30,291,009
差入委託証拠金	285,164,705
(B) 負債	29,233,542,267
未払金	29,123,626,167
未払解約金	109,916,100
(C) 純資産総額(A-B)	30,399,116,682
元本	16,172,496,917
次期繰越損益金	14,226,619,765
(D) 受益権総口数	16,172,496,917口
1万口当り基準価額(C/D)	18,797円

*期首における元本額は7,765,887,299円、当期中における追加設定元本額は10,800,317,302円、同解約元本額は2,393,707,684円です。
*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 13,970,698,284円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 758,224,939円、iFree 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 61,139,199円、ダイワ・ワールド・バランスファンド 50 V A 510,459,045円、ダイワ・ワールド・バランスファンド 75 V A 858,309,210円、ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用) 13,666,240円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は18,797円です。

■損益の状況

当期 自2017年1月11日 至2018年1月10日

項目	当期
(A) 配当等収益	479,925,634円
受取配当金	477,451,868
受取利息	182,523
その他収益	2,536,236
支払利息	△ 244,993
(B) 有価証券売買損益	3,339,703,704
売買益	6,181,353,946
売買損	△ 2,841,650,242
(C) 先物取引等損益	149,400,753
取引益	162,361,450
取引損	△ 13,320,697
(D) その他費用	△ 22,094,118
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	3,946,575,973
(F) 前期繰越損益金	4,535,975,077
(G) 解約差損益金	△ 1,752,354,816
(H) 追加信託差損益金	7,496,423,531
(I) 合計(E+F+G+H)	14,226,619,765
次期繰越損益金(I)	14,226,619,765

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

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主 要 投資対象	ベビーファンド	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式（預託証券を含みます。）
マザーファンドの運用方法	①主として外国の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式実質上限組入比率 マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

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

運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2018年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）」は、このたび、第2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/>

<2732>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率					
1 期末 (2017年 6月15日)	円 12,232	円 0	% 22.3	12,081	% 20.8	% 96.0	% 1.4	% 2.6	百万円 1,719
2 期末 (2018年 6月15日)	円 13,931	円 0	% 13.9	13,533	% 12.0	% 96.1	% 1.5	% 2.4	百万円 3,307

(注1) 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、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数 (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2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

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

(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数 (円ベース) です。

■ 基準価額・騰落率

期 首：12,232円

期 末：13,931円

騰落率：13.9%

■ 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、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		M S C I コクサイ指数 (円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期首)2017年6月15日	円	%		%	%	%	%
	12,232	—	12,081	—	96.0	1.4	2.6
6月末	12,457	1.8	12,271	1.6	95.9	1.5	2.5
7月末	12,546	2.6	12,358	2.3	95.8	1.7	2.6
8月末	12,495	2.2	12,284	1.7	95.2	2.1	2.7
9月末	13,072	6.9	12,833	6.2	96.3	1.2	2.6
10月末	13,369	9.3	13,115	8.6	95.8	1.6	2.6
11月末	13,457	10.0	13,184	9.1	95.5	1.8	2.6
12月末	13,873	13.4	13,572	12.3	95.5	2.0	2.6
2018年1月末	14,023	14.6	13,717	13.5	95.7	1.9	2.4
2月末	13,387	9.4	13,076	8.2	95.9	1.8	2.3
3月末	12,815	4.8	12,493	3.4	95.6	2.0	2.5
4月末	13,382	9.4	13,027	7.8	96.3	1.4	2.4
5月末	13,442	9.9	13,028	7.8	95.7	1.8	2.4
(期末)2018年6月15日	13,931	13.9	13,533	12.0	96.1	1.5	2.4

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■外国株式市況

米国・欧州を中心とする外国株式市況は、期首より横ばいでの推移となりましたが、その後は米国企業の好調な決算発表や米国長期金利の上昇一服などから堅調に推移しました。2017年9月には、北朝鮮による6回目の核実験や米国南部に襲来した大型ハリケーンなど投資家心理が悪化する場面もありましたが、良好な決算発表や景況感の改善などを背景に、市況は底堅く推移しました。2018年1月には、米国株式市場が景気拡大や税制改革を好感して上昇したことで、市況はさらに上値を追う展開となりました。2月以降は、米国の利上げ加速への警戒感などから市況は下落し、その後も米中貿易摩擦が激化することへの懸念などを嫌気し、上値の重い展開となりました。5月以降も、米中貿易摩擦への懸念やイタリア政局の混迷などの悪材料を受け、力強さに欠ける展開のまま期末を迎えました。

■為替相場

為替相場は、期を通して、米ドルやユーロなどの主要通貨が対円で上昇（円安）しました。期首より、ECB（欧州中央銀行）の金融緩和姿勢の後退がユーロなどの上昇要因となりました。2017年9月に入ると、FOMC（米国連邦公開市場委員会）で2017年内の追加利上げの可能性が示唆されたことなどから円安傾向となりました。その後、主要通貨はおおむね横ばいで推移しましたが、2018年に入ると、米国のムニューシン財務長官による米ドル安容認発言などから米ドルが下落しました。2月には、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことや各国の株価が急落したことなどから市場のリスク回避姿勢が強まり、円は上昇傾向となりました。4月以降は、米国の金利が上昇したことなどから米ドルなどが上昇しました。一方、ユーロなどはイタリア情勢の影響から下落しました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

引き続き、「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れることで、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

■外国株式インデックスマザーファンド

引き続き、ベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ベース））の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

ポートフォリオについて

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■当ファンド

「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れました。

■外国株式インデックスマザーファンド

外国株式を中心に、S & P 500先物取引も一部利用し、株式組入比率（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。

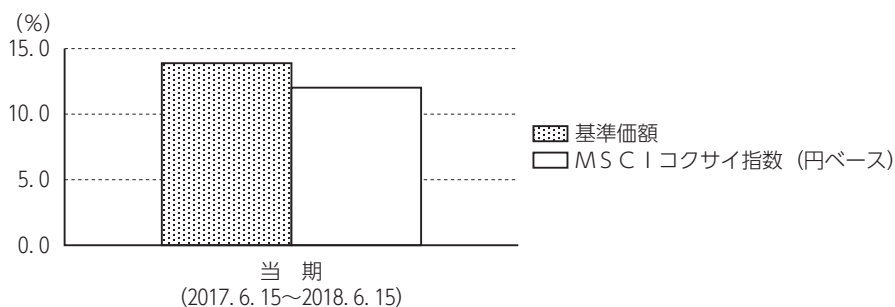
ベンチマークとの差異について

当期のベンチマークの騰落率は12.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は13.9%となりました。

当ファンドが、組み入れているマザー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ことが、かい離要因となりました。

その他、マザーファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、信託報酬、売買コスト等がかい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2017年6月16日 ~2018年6月15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)		3,930

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



今後の運用方針

■当ファンド

「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れることで、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

■外国株式インデックスマザーファンド

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 (2017. 6. 16~2018. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	58円	0. 437%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は13, 210円です。
（投 信 会 社）	(41)	(0. 308)	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）	(14)	(0. 108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 銀 行）	(3)	(0. 022)	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	1	0. 004	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株 式）	(0)	(0. 003)	
（先 物）	(0)	(0. 000)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
有 価 証 券 取 引 税	1	0. 007	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株 式）	(1)	(0. 007)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	8	0. 063	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(7)	(0. 053)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(1)	(0. 005)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	68	0. 511	

（注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

（注2）金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式 インデックス マザーファンド	684,723	1,616,340	144,211	341,916

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

項 目	当 期	
	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	12,346,089千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	90,461,983千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.13	

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	当 期 末		
	期 首	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス マザーファンド	793,528	1,334,039	3,307,217

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス マザーファンド	3,307,217	98.1
コール・ローン等、その他	63,329	1.9
投資信託財産総額	3,370,547	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.68円、1カナダ・ドル=84.33円、1オーストラリア・ドル=82.53円、1香港ドル=14.10円、1シンガポール・ドル=82.20円、1ニュージーランド・ドル=76.93円、1イギリス・ポンド=146.66円、1イスラエル・シケル=30.62円、1スイス・フラン=110.92円、1デンマーク・クローネ=17.17円、1ノルウェー・クローネ=13.60円、1スウェーデン・クローネ=12.64円、1ユーロ=127.90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(103,482,398千円)の投資信託財産総額(103,704,052千円)に対する比率は、99.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,370,547,674円
コール・ローン等	29,455,191
外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	3,307,217,683
未収入金	33,874,800
(B) 負債	63,106,706
未払解約金	56,883,038
未払信託報酬	6,147,741
その他未払費用	75,927
(C) 純資産総額(A-B)	3,307,440,968
元本	2,374,174,372
次期繰越損益金	933,266,596
(D) 受益権総口数	2,374,174,372口
1万口当り基準価額(C/D)	13,931円

* 期首における元本額は1,405,993,525円、当期中における追加設定元本額は1,380,206,909円、同解約元本額は412,026,062円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,931円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,149円
受取利息	177
支払利息	△ 2,326
(B) 有価証券売買損益	275,717,078
売買益	311,807,719
売買損	△ 36,090,641
(C) 信託報酬等	△ 10,651,471
(D) 当期損益金(A+B+C)	265,063,458
(E) 前期繰越損益金	58,740,207
(F) 追加信託差損益金	609,462,931
(配当等相当額)	(67,245,126)
(売買損益相当額)	(542,217,805)
(G) 合計(D+E+F)	933,266,596
次期繰越損益金(G)	933,266,596
追加信託差損益金	609,462,931
(配当等相当額)	(67,245,126)
(売買損益相当額)	(542,217,805)
分配準備積立金	323,805,814
繰越損益金	△ 2,149

(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いません。

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

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	265,065,250
(c) 収益調整金	609,462,931
(d) 分配準備積立金	58,740,564
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	933,268,745
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	933,268,745
(h) 受益権総口数	2,374,174,372口

<補足情報>

当ファンド（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））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（2017年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15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75～93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

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.03	150,250	145,874	BRITISH AMERICAN TOB-SP ADR (イギリス)	10.245	73,700	7,193
APPLE INC (アメリカ)	6.7	125,841	18,782	ACTELION LTD-REG (スイス)	2.25	71,670	31,853
MICROSOFT CORP (アメリカ)	12.85	124,953	9,724	APPLE INC (アメリカ)	2.9	47,719	16,455
FACEBOOK INC-A (アメリカ)	6.15	118,125	19,207	CHRISTIAN DIOR SE (フランス)	1.3	40,422	31,094
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC (イギリス)	13.95	98,672	7,073	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA (スペイン)	17.4	40,289	2,315
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	11.1	96,015	8,650	GKN PLC (イギリス)	43.6	30,503	699
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.79	90,862	115,015	ALLERGAN PLC (アイルランド)	1.1	29,188	26,535
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	3.85	82,261	21,366	WYNDHAM DESTINATIONS INC (アメリカ)	2.4	28,802	12,000
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.63	73,060	115,968	WORLDPAY INC-CLASS A (アメリカ)	3.165	27,671	8,742
NVIDIA CORP (アメリカ)	2.95	64,450	21,847	MOBILEYE NV (オランダ)	3.9	27,336	7,009

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年6月15日現在における外国株式インデックスマザーファンド（41,775,947千円）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	株数	2018年6月15日現在		業種等
		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	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	28.5	327	36,240	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	22	474	52,487	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	48	293	32,523	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	14.5	256	28,442	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	188	662	73,368	金融
ABBOTT LABORATORIES	427.66	2,692	298,011	ヘルスケア
ARCONIC INC	103.33	185	20,585	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	39	428	47,468	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	96	773	85,639	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	74.5	679	75,200	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	80.79	870	96,321	情報技術
QORVO INC	31	259	28,700	情報技術
AFLAC INC	190	867	96,061	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	29.5	271	30,100	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	35	162	18,032	一般消費財・サービス
ADOBE SYSTEMS INC	119.5	3,084	341,369	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	55	247	27,344	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	26	327	36,224	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	80	150	16,637	金融
GARMIN LTD	29	179	19,881	一般消費財・サービス
AETNA INC	78.79	1,481	164,023	ヘルスケア
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	53.5	886	98,129	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	184	2,782	307,920	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	41.71	363	40,227	情報技術
WR BERKLEY CORP	23	173	19,163	金融
AUTOZONE INC	6.6	450	49,891	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	57.21	505	55,936	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	225	535	59,219	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	26.5	199	22,117	公益事業
CELANESE CORP-SERIES A	33	379	42,039	素材
DR HORTON INC	87.16	375	41,558	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	24.5	157	17,425	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	54.5	244	27,077	ヘルスケア
AUTODESK INC	55	761	84,255	情報技術
MOODY'S CORP	42.5	747	82,755	金融
DEVON ENERGY CORP	124.5	519	57,474	エネルギー
ALBEMARLE CORP	28	262	29,025	素材
ATMOS ENERGY CORP	25	214	23,707	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	57.5	227	25,214	公益事業
CITIGROUP INC	644.73	4,265	472,109	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	108.5	1,517	167,906	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	121	781	86,540	公益事業
ALLEGHANY CORP	3.7	215	23,817	金融
DOMINO'S PIZZA INC	11	301	33,316	一般消費財・サービス
HESS CORP	72	438	48,586	エネルギー

銘柄	2018年6月15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		
DAVITA INC	35	248	27,519	ヘルスケア
DANAHER CORP	154	1,580	174,947	ヘルスケア
FORTIVE CORP	75	600	66,515	資本財・サービス
AVNET INC	28	112	12,451	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	141.5	1,054	116,707	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	49	115	12,728	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	47.28	102	11,371	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	136	615	68,097	生活必需品
BUNGE LTD	36	253	28,110	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	85.25	846	93,703	情報技術
APPLE INC	1,250	23,850	2,639,718	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	90	676	74,908	金融
BOEING CO/THE	137.9	4,997	553,153	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	39.15	269	29,863	金融
BECTON DICKINSON AND CO	65.39	1,522	168,500	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	60	178	19,789	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	35.5	215	23,869	情報技術
CDK GLOBAL INC	29	190	21,139	情報技術
NISOURCE INC	85	203	22,569	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	33.5	302	33,529	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	251.71	1,429	158,240	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,004.54	4,803	531,674	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	309.5	5,957	659,417	金融
ANSYS INC	21	371	41,121	情報技術
H&R BLOCK INC	51	121	13,417	一般消費財・サービス
BB&T CORP	192.5	1,009	111,728	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	401	2,150	238,024	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	845.2	9,130	1,010,585	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	60	741	82,120	金融
CIGNA CORP	60.5	1,060	117,403	ヘルスケア
LKQ CORP	78	258	28,618	一般消費財・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	10	123	13,718	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	64.62	342	37,863	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	67.5	303	33,574	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	36.1	533	58,994	金融
DOLLAR GENERAL CORP	66.5	640	70,900	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	42.5	787	87,182	情報技術
CATERPILLAR INC	144.5	2,212	244,920	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	67.5	294	32,588	公益事業
MOSAIC CO/THE	90.5	266	29,528	素材
DELTA AIR LINES INC	43.5	238	26,432	資本財・サービス
CORNING INC	213	615	68,107	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,204	5,380	595,533	情報技術
MORGAN STANLEY	330	1,693	187,406	金融
WABCO HOLDINGS INC	12.5	153	17,012	資本財・サービス
MSCI INC	21.5	370	41,012	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	9	190	21,069	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	13	138	15,276	資本財・サービス
COTY INC-CL A	118.39	168	18,685	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	52	275	30,514	情報技術
BROADCOM INC	100.02	2,685	297,190	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	10.5	119	13,268	ヘルスケア
ACUITY BRANDS INC	10	120	13,366	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	21.8	233	25,831	ヘルスケア
ARAMARK	58.5	232	25,743	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	53.5	166	18,474	素材
DTE ENERGY COMPANY	43.5	422	46,725	公益事業
CENTENE CORP	50.5	623	69,028	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	28	290	32,171	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	121.5	503	55,673	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	43	283	31,401	金融
GARTNER INC	22	302	33,429	情報技術
SPLUNK INC	33.5	400	44,307	情報技術
AGCO CORP	14.5	89	9,900	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC	157.5	1,031	114,215	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	105.5	591	65,448	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	36.5	233	25,842	資本財・サービス
DEERE & CO	75	1,126	124,664	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	38	447	49,523	情報技術
TIME WARNER INC	190.33	1,879	208,066	一般消費財・サービス
VMWARE INC-CLASS A	18	270	29,933	情報技術
CHEMOURS CO/THE	45.5	226	25,068	素材
NASDAQ INC	29	274	30,418	金融
VAIL RESORTS INC	9.5	267	29,554	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	36.5	256	28,351	金融
TARGA RESOURCES CORP	53.5	259	28,730	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	16.5	236	26,204	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	18	197	21,868	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	10.5	117	13,049	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	75.5	553	61,210	公益事業
COGNEX CORP	41.5	189	21,027	情報技術
TELEFLEX INC	11.3	321	35,539	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2018年6月15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		
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	21	272	30,134	資本財・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	27.5	228	25,271	ヘルスケア
IDEX CORP	19.5	280	31,007	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	204.5	1,294	143,296	生活必需品
ROLLINS INC	25.5	133	14,752	資本財・サービス
AMETEK INC	57.75	432	47,836	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	61	303	33,622	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	32	133	14,808	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	31	346	38,311	資本財・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A	82.5	941	104,231	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	106.5	2,184	241,783	生活必需品
SCANA CORP	31	114	12,660	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	13.5	209	23,235	金融
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6	276	30,576	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	76	171	18,934	金融
UGI CORP	42	206	22,894	公益事業
CUMMINS INC	38.5	546	60,461	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	175.5	1,363	150,946	情報技術
SABRE CORP	51	134	14,907	情報技術
CDW CORP/DE	37.5	314	34,797	情報技術
SIGNATURE BANK	13	163	18,138	金融
COSTAR GROUP INC	9	368	40,811	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	13	411	45,537	金融
AMERCO	1.7	59	6,624	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15	240	26,609	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	10	305	33,757	情報技術
HANESBRANDS INC	85	171	18,975	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	19.5	255	28,292	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	70.66	585	64,856	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	46	139	15,411	情報技術
IPG PHOTONICS CORP	9	217	24,022	情報技術
COPART INC	54	313	34,712	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	24.5	284	31,441	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	26	170	18,845	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	18.7	684	75,807	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	12.8	440	48,758	資本財・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	90	283	31,407	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	487.81	826	91,514	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	68	720	79,785	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	111.5	263	29,136	エネルギー
T-MOBILE US INC	85.5	508	56,334	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	25	162	18,010	情報技術
COCA-COLA CO/THE	986	4,296	475,590	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	53	209	23,170	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	42.5	326	36,111	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	27.5	150	16,706	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	79.5	263	29,168	金融
CSX CORP	214	1,410	156,063	資本財・サービス
FLUOR CORP	33	161	17,856	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	24.5	460	50,946	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	30.25	373	41,375	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	21.5	342	37,864	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	100.7	17,359	1,921,324	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	55.5	153	17,027	エネルギー
FLOWERVE CORP	32	132	14,712	資本財・サービス
EDWARDS LIFSCIENCES CORP	52	788	87,228	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,031.05	8,443	934,500	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	34	184	20,433	情報技術
AES CORP	156	205	22,756	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	19	375	41,587	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	10.2	230	25,513	金融
EOG RESOURCES INC	141.5	1,663	184,066	エネルギー
EQT CORP	62.5	351	38,848	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	41.5	335	37,140	情報技術
ABIOMED INC	10.8	475	52,672	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	40	373	41,327	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	79.9	529	58,640	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	897.23	1,066	118,074	一般消費財・サービス
MACY'S INC	74.98	281	31,170	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	34.4	87	9,708	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48.87	143	15,929	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC-C	72.89	176	19,482	一般消費財・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	34	185	20,527	資本財・サービス
FORTINET INC	35	230	25,466	情報技術
MARKEL CORP	3.4	373	41,390	金融
NEXTERA ENERGY INC	114.5	1,818	201,270	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	341.08	599	66,365	素材
US BANCORP	403.5	2,055	227,450	金融
UNITED RENTALS INC	21.5	353	39,135	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	16	290	32,166	情報技術
FASTENAL CO	72	380	42,068	資本財・サービス
FISERV INC	102.5	783	86,707	情報技術

銘柄	2018年6月15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		
GENERAL ELECTRIC CO	2,116.5	2,886	319,522	資本財・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	41	231	25,598	ヘルスケア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	52	283	31,337	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	60.5	151	16,807	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	313	1,363	150,938	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	27.5	158	17,571	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	62	1,214	134,374	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	87.4	2,042	226,019	金融
ALPHABET INC-CL A	72.6	8,422	932,191	情報技術
ALPHABET INC-CL C	76.87	8,856	980,220	情報技術
OWENS CORNING	27.5	179	19,844	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	140.5	625	69,215	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	110.68	379	41,980	公益事業
GENUINE PARTS CO	35	329	36,440	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	96.34	489	54,124	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	176	542	60,075	金融
HARRIS CORP	28.5	427	47,299	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	30	129	14,304	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	210.5	1,004	111,202	エネルギー
HOME DEPOT INC	284.5	5,680	628,730	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	12.5	119	13,248	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	272	419	46,421	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	10.9	239	26,535	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	35	322	35,693	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	40	176	19,568	一般消費財・サービス
HUMANA INC	35	1,065	117,930	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	82	926	102,565	情報技術
HELMERICH & PAYNE	26	168	18,696	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	38	276	30,652	ヘルスケア
HP INC	402	956	105,894	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	394	623	68,987	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	43	200	22,168	一般消費財・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	43	313	34,723	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	49	163	18,103	一般消費財・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	21	97	10,777	一般消費財・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31	251	27,836	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	149.03	904	100,072	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	223.5	3,245	359,180	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	94.5	537	59,450	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	36	204	22,631	資本財・サービス
ZOETIS INC	118	1,040	115,126	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	62.79	577	63,873	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	50.5	327	36,291	エネルギー
ALLEGION PLC	24.5	200	22,178	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	31	137	15,182	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	136.73	393	43,523	一般消費財・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	64.57	492	54,564	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	89	247	27,404	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	27.2	282	31,233	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	654	8,005	886,061	ヘルスケア
ABBVIE INC	389.79	3,849	426,026	ヘルスケア
HOLOGIC INC	65.5	263	29,164	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	86.5	882	97,691	生活必需品
KROGER CO	218.5	571	63,264	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	38.5	435	48,206	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	63	1,956	216,569	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	22	452	50,045	情報技術
L BRANDS INC	59	212	23,501	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	202.5	2,007	222,244	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	242	2,089	231,284	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	40.3	730	80,809	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	11	187	20,758	不動産
LOEWS CORP	72.5	359	39,808	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	54.49	370	41,040	金融
MCDONALD'S CORP	193	3,224	356,839	一般消費財・サービス
3M CO	145.5	2,962	327,924	資本財・サービス
FACEBOOK INC-A	586	11,533	1,276,479	情報技術
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	51.04	448	49,661	情報技術
MANPOWERGROUP INC	16	148	16,481	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	61.5	1,274	141,098	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	15	345	38,217	素材
CONCHO RESOURCES INC	36	458	50,702	エネルギー
FIRST DATA CORP- CLASS A	111.5	240	26,668	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	53	193	21,446	電気通信サービス
PHILLIPS 66	109.5	1,265	140,040	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	111.5	358	39,688	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	134	421	46,614	一般消費財・サービス
MATTEL INC	87	155	17,255	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	70.38	594	65,783	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	30	317	35,149	生活必需品
MYLAN NV	128.5	507	56,192	ヘルスケア
METLIFE INC	219	1,024	113,365	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2018年6月15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		
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	111	241	26,733	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	12.9	362	40,137	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	38	177	19,595	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	40.28	458	50,778	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6.4	379	41,984	ヘルスケア
BAKER HUGHES A GE CO	102.73	345	38,294	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	30.8	551	60,999	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	19.4	87	9,718	金融
MERCK & CO. INC.	664.71	4,091	452,897	ヘルスケア
DOWDUPONT INC	571.05	3,904	432,187	素材
MASCO CORP	79	303	33,593	資本財・サービス
M & T BANK CORP	35.19	614	68,046	金融
MARSH & MCLENNAN COS	123	1,007	111,550	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	74.72	1,036	114,746	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	33	423	46,824	情報技術
SQUARE INC - A	70.5	450	49,845	情報技術
TRANSUNION	44	313	34,712	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP	87	208	23,119	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	38.5	253	28,059	一般消費財・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	72.5	611	67,652	情報技術
NETAPP INC	64.5	499	55,326	情報技術
NIKE INC -CL B	322	2,405	266,223	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	69	1,058	117,203	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	56.5	579	64,141	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	32	315	34,868	金融
ALLY FINANCIAL INC	107	281	31,193	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	40.3	1,299	143,874	資本財・サービス
APTIV PLC	65	666	73,819	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	130	509	56,344	素材
MCKESSON CORP	50.5	757	83,840	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	71	436	48,273	情報技術
XYLEM INC	45	322	35,725	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	379	3,064	339,147	生活必需品
NUCOR CORP	77	527	58,403	素材
WESTERN UNION CO	117.46	242	26,858	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	36	264	29,305	情報技術
NEWELL BRANDS INC	122.92	324	35,903	一般消費財・サービス
EVERGY INC	34.5	179	19,836	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	187	1,577	174,580	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	25.5	195	21,590	一般消費財・サービス
PAYCHEX INC	78.5	544	60,245	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21.2	597	66,143	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	464	2,630	291,185	生活必需品
P G & E CORP	125	498	55,187	公益事業
PFIZER INC	1,451.63	5,249	580,969	ヘルスケア
ALKERMES PLC	36	180	19,978	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	124	531	58,836	公益事業
STRYKER CORP	82	1,383	153,153	ヘルスケア
PARKER HANNUFIN CORP	33	567	62,789	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	41.5	794	87,937	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	14	181	20,035	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	618.17	4,697	519,916	生活必需品
EXELON CORP	232.22	953	105,558	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	55	660	73,146	ヘルスケア
NVR INC	0.9	280	31,025	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	293	1,996	220,940	エネルギー
PEPSICO INC	347	3,648	403,761	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	102.5	1,012	112,028	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	42.5	339	37,527	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	149	2,425	268,412	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	19.5	110	12,226	金融
PENTAIR PLC	42.05	184	20,375	資本財・サービス
QUALCOMM INC	362.5	2,155	238,562	情報技術
INVESCO LTD	101.5	276	30,567	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	19	253	28,073	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	72	405	44,833	金融
RAYTHEON COMPANY	71.2	1,443	159,720	資本財・サービス
RED HAT INC	43	756	83,715	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	19	599	66,382	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	56	387	42,909	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	11.8	2,505	277,276	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	93	785	86,977	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	24	289	32,083	素材
RESMED INC	34	362	40,175	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	33	366	40,520	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	30.5	213	23,606	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	13	180	20,012	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	39.63	546	60,477	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	288.35	536	59,424	金融
CHEVRON CORP	462.68	5,853	647,850	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	78.5	472	52,304	公益事業
TESLA INC	33	1,180	130,655	一般消費財・サービス

銘柄	2018年6月15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		
SYMANTEC CORP	150.5	321	35,580	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	37.22	529	58,616	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	37.5	340	37,715	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	45.05	1,331	147,395	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	75	362	40,093	不動産
TWITTER INC	168	785	86,946	情報技術
SOUTHERN CO/THE	245	1,083	119,882	公益事業
SYSCO CORP	122	811	89,767	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	66.23	853	94,458	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	32	210	23,272	金融
STERICYCLE INC	21.5	138	15,279	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	57	279	30,919	素材
SCHLUMBERGER LTD	336.52	2,299	254,502	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	41.5	223	24,720	資本財・サービス
AT&T INC	1,495.41	4,863	538,244	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	36.5	189	20,982	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	110	284	31,520	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	20.4	818	90,585	素材
SEMPRA ENERGY	58	657	72,745	公益事業
TIFFANY & CO	29.5	400	44,297	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	70.5	416	46,099	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	241	2,764	306,002	情報技術
SALESFORCE.COM INC	166.5	2,304	255,064	情報技術
WESTROCK CO	61.8	373	41,382	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	222.84	777	86,052	資本財・サービス
ANDEAVOR	36.5	507	56,161	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	190.5	2,761	305,599	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	213	449	49,790	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	119	894	99,032	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	184	2,335	258,514	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	167.5	1,962	217,257	資本財・サービス
UNUM GROUP	54	209	23,207	金融
SPRINT CORP	207.65	113	12,548	電気通信サービス
ANTERO RESOURCES CORP	51	100	11,153	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	39.44	406	45,031	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	43.5	224	24,891	金融
AMEREN CORPORATION	58	326	36,186	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	236.26	6,032	667,668	ヘルスケア
VERISIGN INC	21.5	303	33,604	情報技術
VALERO ENERGY CORP	105.92	1,237	136,950	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	14.1	347	38,484	一般消費財・サービス
FNF GROUP	68.38	261	28,918	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	21	240	26,633	ヘルスケア
ANTHEM INC	62.9	1,520	168,293	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	368.5	4,007	443,543	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	1,139.72	6,238	690,513	金融
WASTE MANAGEMENT INC	106.5	890	98,507	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	200	544	60,232	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	32	237	26,322	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	17	264	29,252	一般消費財・サービス
WALMART INC	364.5	3,054	338,032	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	29	256	28,335	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	50.5	580	64,210	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	24	423	46,817	一般消費財・サービス
XEROX CORP	52.11	144	15,999	情報技術
WABTEC CORP	20.5	209	23,145	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	156.5	1,479	163,791	一般消費財・サービス
WATERS CORP	19	380	42,115	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	18	131	14,547	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	82.07	1,427	158,007	ヘルスケア
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	211	1,368	151,494	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	31.33	488	54,108	金融
WESTERN DIGITAL CORP	73	602	66,697	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	78.3	468	51,876	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	122	637	70,512	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	442	5,967	660,427	情報技術
PPL CORP	167	452	50,034	公益事業
PULTEGROUP INC	62.5	192	21,305	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	61.5	639	70,763	素材
NORTHERN TRUST CORP	53.5	572	63,329	金融
NVIDIA CORP	148	3,950	437,215	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	18.5	300	33,224	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	116.43	1,651	182,781	金融
QURATE RETAIL INC	114.5	245	27,183	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	47	203	22,519	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	74.5	528	58,535	生活必需品
NETFLIX INC	105.5	4,144	458,744	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	97.5	2,111	233,685	ヘルスケア
TORCHMARK CORP	26.75	225	24,929	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	39.5	395	43,744	金融
TEXTRON INC	63.5	428	47,433	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	258.5	1,152	127,546	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	2018年6月15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		
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	110	488	54,080	一般消費財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	92.37	147	16,378	一般消費財・サービス
OGE ENERGY CORP	47	162	17,977	公益事業
OMNICOM GROUP	57	429	47,549	一般消費財・サービス
ORACLE CORP	763.33	3,503	387,787	情報技術
MASTERCARD INC - A	229	4,564	505,165	情報技術
ONEOK INC	102.5	710	78,664	エネルギー
CENTURYLINK INC	239.52	431	47,744	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	25	708	78,364	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	83	692	76,596	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	28.5	347	38,432	情報技術
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	12.3	278	30,830	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	46	306	33,969	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	116	401	44,384	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	2,413.01	7,118	787,862	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	43	386	42,823	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	149	16,558	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	179.5	1,790	198,193	金融
ANALOG DEVICES INC	88.99	905	100,168	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	228	370	41,006	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	68	407	45,149	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	217.22	1,190	131,749	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	135	959	106,146	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	45	458	50,787	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	42	476	52,761	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	51	148	16,482	エネルギー
AVERY DENNISON CORP	21	223	24,700	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	145.5	1,142	126,496	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	157	1,144	126,676	資本財・サービス
AON PLC	60.5	848	93,886	金融
AMGEN INC	172.5	3,204	354,715	ヘルスケア
TAPESTRY INC	71	323	35,778	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	107.36	851	94,205	資本財・サービス
CELGENE CORP	192	1,505	166,583	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	41.8	970	107,416	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	263	1,306	144,641	情報技術
CIT GROUP INC	33	169	18,751	金融
CIMAREX ENERGY CO	22.5	194	21,553	エネルギー
CME GROUP INC	84	1,418	156,991	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	92.44	389	43,134	エネルギー
ECOLAB INC	64	930	102,994	素材
EQUIFAX INC	29	363	40,230	資本財・サービス
GAP INC/THE	59.5	186	20,632	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	316	2,248	248,846	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	43.48	524	58,051	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	73.5	265	29,375	生活必需品
STATE STREET CORP	89.43	878	97,258	金融
SUNTRUST BANKS INC	115.48	795	88,050	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	295	1,669	184,835	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	127	957	105,999	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	44	160	17,780	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	31	139	15,429	素材
CARDINAL HEALTH INC	78	426	47,153	ヘルスケア
FEDEX CORP	62	1,633	180,804	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	118.54	1,141	126,319	金融
FMC CORP	33.5	302	33,481	素材
FLEX LTD	129	180	20,003	情報技術
CERNER CORP	73	445	49,350	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19	236	26,183	素材
CITRIX SYSTEMS INC	37	395	43,744	情報技術
INTEL CORP	1,140	6,331	700,777	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	94	221	24,532	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	86	456	50,524	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	74.5	1,109	122,769	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	385	284	31,447	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC	35.5	1,030	114,007	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	44	193	21,461	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	27.1	1,342	148,627	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	31.5	314	34,843	情報技術
SNAP-ON INC	14	223	24,711	資本財・サービス
CARMAX INC	46	336	37,278	一般消費財・サービス
COMERICA INC	42	399	44,244	金融
INGREDION INC	17	192	21,286	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	172.78	1,269	140,479	公益事業
TARGET CORP	125	965	106,833	一般消費財・サービス
DOVER CORP	39	296	32,831	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	13	412	45,667	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	31	202	22,422	資本財・サービス
CINTAS CORP	22	421	46,644	資本財・サービス
CA INC	75.05	278	30,784	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	100	382	42,279	生活必需品
CLOROX COMPANY	31	396	43,880	生活必需品

銘柄	2018年6月15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		
ENTERGY CORP	44	337	37,357	公益事業
MICROSOFT CORP	1,783	18,083	2,001,447	情報技術
INCYTE CORP	43	316	35,047	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	246.74	1,705	188,761	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	330.88	2,864	317,034	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	282	1,668	184,711	情報技術
BLACKROCK INC	29.4	1,538	170,300	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	103	269	29,845	公益事業
HASBRO INC	28.5	261	28,897	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	64.5	429	47,544	生活必需品
KEYCORP	267	548	60,669	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	25.5	277	30,667	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	366.11	1,479	163,705	生活必需品
KOHL'S CORP	41.5	304	33,659	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	12	282	31,231	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	120	138	15,326	金融
APACHE CORP	92.6	397	43,957	エネルギー
CHUBB LTD	113.49	1,476	163,419	金融
ARROW ELECTRONICS INC	21.5	170	18,822	情報技術
ALLSTATE CORP	89	825	91,412	金融
EBAY INC	239	932	103,164	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC	278	2,379	263,413	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	34.5	372	41,212	素材
XILINX INC	61.5	433	47,940	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	138.6	1,139	126,158	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP-A	57.5	195	21,688	一般消費財・サービス
ZIONS BANCORPORATION	48	266	29,458	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	55	860	95,188	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	38	148	16,423	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	64	226	25,075	情報技術
LENNAR CORP-A	71	376	41,703	一般消費財・サービス
LEAR CORP	16.5	334	37,015	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	65	421	46,647	金融
PROGRESSIVE CORP	143	885	97,954	金融
PRAXAIR INC	70	1,130	125,162	素材
PACCAR INC	86.87	553	61,303	資本財・サービス
PVH CORP	18.5	296	32,810	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	51.6	1,577	174,576	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	21	474	52,547	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	346	1,972	218,359	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC	30.5	228	25,260	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	77.3	417	46,191	公益事業
INTUIT INC	59.5	1,244	137,688	情報技術
BORGWARNER INC	51	248	27,557	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	65	476	52,747	一般消費財・サービス
BALL CORP	80.34	296	32,793	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	332.47	1,080	119,629	ヘルスケア
XL GROUP LTD	61	342	37,943	金融
ELECTRONIC ARTS INC	75.5	1,090	120,657	情報技術
VULCAN MATERIALS CO	32	421	46,701	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	62	960	106,356	ヘルスケア
VF CORP	83.5	701	77,658	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	83.71	461	51,068	一般消費財・サービス
VIACOM INC-CLASS B	86.71	250	27,745	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	15.7	336	37,205	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	22	271	30,025	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	106.5	683	75,675	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,137.9	3,848	425,938	一般消費財・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	52	192	21,294	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	53	332	36,803	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	90	79	8,815	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	285	210	23,342	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	75,001.08 599銘柄	596,423 <63.7%>	66,012,121
(カナダ)		百株	千カナダ・ドル	千円
IMPERIAL OIL LTD	71	306	25,841	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	5	524	44,272	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	50.96	133	11,276	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	55.87	440	37,122	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	107	312	26,311	素材
INTACT FINANCIAL CORP	35.5	337	28,470	金融
BCE INC	37.3	202	17,083	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	47	429	36,182	素材
SUNCOR ENERGY INC	411.3	2,144	180,847	エネルギー
METRO INC	55	241	20,380	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	85	542	45,710	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	298	2,264	190,940	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	107.5	1,238	104,434	金融
TORONTO-DOMINION BANK	456	3,474	293,023	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	76	253	21,374	金融
ROYAL BANK OF CANADA	359.5	3,589	302,711	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
TOURMALINE OIL CORP	54	130	10,983	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	28	128	10,826	エネルギー
TRANSCANADA CORP	216.5	1,180	99,557	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	127.29	575	48,573	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	530	259	21,855	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	286	493	41,604	素材
CAE INC	65	178	15,068	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	71.04	381	32,188	金融
EMPIRE CO LTD 'A'	46	112	9,527	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	16	137	11,621	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	34.5	227	19,207	素材
LINAMAR CORP	13	82	6,986	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	64	94	7,993	エネルギー
HYDRO ONE LTD	72	140	11,846	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	54.6	359	30,287	生活必需品
WSP GLOBAL INC	27	199	16,810	資本財・サービス
EMERA INC	13	52	4,410	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	33	103	8,746	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	90	557	47,010	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	59	359	30,330	素材
KINROSS GOLD CORP	295	146	12,364	素材
BANK OF MONTREAL	163	1,659	139,987	金融
POWER CORP OF CANADA	86	263	22,214	金融
METHANEX CORP	22	197	16,617	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	22	484	40,854	情報技術
NUTRIEN LTD	159.19	1,119	94,387	素材
CAMECO CORP	92	145	12,297	エネルギー
TELUS CORP	54	249	21,052	電気通信サービス
POWER FINANCIAL CORP	62	200	16,867	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	140	524	44,190	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	16	276	23,353	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	248	93	7,842	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	308	1,293	109,063	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	7	532	44,871	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	87	745	62,904	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	13	135	11,392	生活必需品
BLACKBERRY LTD	119	190	16,056	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	152.5	834	70,371	金融
ENBRIDGE INC	428	1,827	154,082	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	208.5	1,147	96,758	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	494	1,228	103,605	金融
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	87	305	25,729	ヘルスケア
GOLDCORP INC	218.59	409	34,544	素材
ENCANA CORP	243	403	34,017	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	36	915	77,238	資本財・サービス
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	25	131	11,068	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	56	211	17,874	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	185.5	2,029	171,183	資本財・サービス
CGI GROUP INC - CLASS A	65	529	44,619	情報技術
HUSKY ENERGY INC	84.58	167	14,101	エネルギー
ONEX CORPORATION	20	185	15,639	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	107	295	24,958	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	44	149	12,593	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	45	268	22,621	資本財・サービス
IGM FINANCIAL INC	19	75	6,370	金融
OPEN TEXT CORP	66	310	26,214	情報技術
CI FINANCIAL CORP	70	174	14,734	金融
SAPUTO INC	58	252	21,291	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	177	388	32,763	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	110	602	50,824	生活必需品
FORTIS INC	104	422	35,607	公益事業
LUNDIN MINING CORP	161	134	11,336	素材
CRESCENT POINT ENERGY CORP	133	130	10,969	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	272	336	28,396	エネルギー
DOLLARAMA INC	26	394	33,263	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	17	66	5,622	公益事業
ALTAGAS LTD	45	117	9,923	エネルギー
FIRST CAPITAL REALTY INC	38	80	6,755	不動産
KEYERA CORP	48	173	14,604	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	95	233	19,675	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	83	109	9,246	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	10,072.72 87銘柄	45,492 <3.7%>	3,836,346
(オーストラリア)	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD	455	104	8,599	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD	665	192	15,915	金融
BHP BILLITON LIMITED	796.5	2,658	219,423	素材
SOUTH32 LTD	1,286	489	40,436	素材
ALUMINA LTD	623	170	14,088	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	235	792	65,398	エネルギー

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千オーストラリア・ドル	千円		
FORTESCUE METALS GROUP LTD	388	180	14,890	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	118	120	9,904	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	687.5	1,784	147,238	金融
WESTPAC BANKING CORP	840.48	2,294	189,365	金融
SANTOS LTD	452	263	21,710	エネルギー
AUSNET SERVICES	410	63	5,261	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	736	1,928	159,144	金融
RIO TINTO LTD	104.5	884	72,979	素材
ORIGIN ENERGY LTD	437	423	34,983	エネルギー
AMCOR LIMITED	281	387	31,980	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	495	213	17,648	資本財・サービス
OIL SEARCH LTD	329	275	22,753	エネルギー
SEEK LTD	83	175	14,501	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	180	315	26,071	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	186.5	382	31,553	素材
INCITEC PIVOT LTD	423	145	12,044	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	433.5	2,923	241,314	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	64.5	195	16,139	エネルギー
ORICA LTD	92	159	13,203	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	343	318	26,326	金融
CIMIC GROUP LTD	24	97	8,013	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	330	956	78,926	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	137	121	10,028	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	484	222	18,334	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	96	127	10,497	一般消費財・サービス
TELSTRA CORP LTD	1,046	303	25,034	電気通信サービス
AMP LTD	750	272	22,468	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	111	240	19,833	素材
MACQUARIE GROUP LTD	79.84	905	74,754	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	145.5	430	35,544	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	91	90	7,442	金融
CSL LTD	113.5	2,120	174,969	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	278.95	1,311	108,202	生活必需品
COCHLEAR LTD	14	265	21,929	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	134	245	20,293	素材
SUNCORP GROUP LTD	327	453	37,431	金融
BORAL LTD	277	175	14,493	素材
ASX LTD	47	291	24,029	金融
COMPUTERSHARE LTD	114	203	16,812	情報技術
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	49	4,043	一般消費財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	610	484	39,972	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	104	248	20,513	ヘルスケア
CHALLENGER LTD	139	171	14,190	金融
AGL ENERGY LTD	164	351	29,018	公益事業
BRAMBLES LTD	395	356	29,437	資本財・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	14	87	7,228	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	35.5	205	16,928	ヘルスケア
TPG TELECOM LTD	87	47	3,927	電気通信サービス
REA GROUP LTD	12	108	8,924	情報技術
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	14	72	5,942	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 >	17,458.77 56銘柄	28,862 2,382,046	<2.3%>
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	350	1,935	27,290	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	590	3,826	53,948	一般消費財・サービス
MTR CORP	380	1,656	23,360	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	400	4,928	69,484	不動産
SINO LAND CO	740	988	13,939	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	661.69	5,842	82,382	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	320	816	11,505	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	125	1,037	14,628	不動産
CLP HOLDINGS LTD	415	3,371	47,543	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	329.16	1,449	20,444	不動産
HANG LUNG GROUP LTD	210	496	7,002	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	2,301.81	3,420	48,228	公益事業
HANG SENG BANK LTD	196	3,878	54,691	金融
WHEELLOCK & CO LTD	200	1,153	16,257	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,490	1,767	24,916	不動産
WH GROUP LTD	2,225	1,548	21,835	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	294	7,514	105,956	金融
MINTH GROUP LTD	180	668	9,428	一般消費財・サービス
LI & FUNG LTD	1,520	457	6,451	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	500	865	12,196	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	76	804	11,348	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	190	441	6,228	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	355	517	7,298	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	175	749	10,573	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	326.4	1,044	14,727	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	170	760	10,726	不動産
SJM HOLDINGS LTD	470	485	6,852	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	288	888	12,527	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	636.69	4,179	58,936	不動産

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2018年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千香港ドル	千円	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	160	945	13,332	公益事業
PCCW LTD	950	426	6,014	電気通信サービス
AIA GROUP LTD	3,046	21,367	301,284	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	300	1,783	25,147	不動産
SANDS CHINA LTD	604	2,733	38,536	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	300	500	7,055	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	330	1,559	21,985	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	236	499	7,037	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	920	3,661	51,628	金融
WYNN MACAU LTD	380	1,075	15,163	一般消費財・サービス
香港ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	23,340.75 39銘柄	92,049 <1.3%>	
	百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)				
UNITED OVERSEAS BANK LTD	331	892	73,326	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	442	1,220	100,313	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	136.7	152	12,573	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	363	262	21,603	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	140	107	8,826	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	104	116	9,583	不動産
CAPITALAND LTD	630	213	17,555	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING	568	54	4,505	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	410	107	8,863	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	27	89	7,357	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	790	958	78,769	金融
GENTING SINGAPORE LTD	1,530	186	15,343	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	72	144	11,901	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,038.5	650	53,453	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	395	136	11,201	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	227	63	5,224	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,644	52	4,324	生活必需品
SATS LTD	160	80	6,602	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	208	149	12,327	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	553	128	10,545	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	432	141	11,647	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,201.2 21銘柄	5,910 <0.5%>	
	百株	千ニューージーランド・ドル	千円	
(ニューージーランド)				
MERIDIAN ENERGY LTD	260	81	6,300	公益事業
A2 MILK CO LTD	190	218	16,809	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	526.89	200	15,402	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	234	162	12,475	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	201	135	10,437	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	135	202	15,588	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	88	105	8,123	ヘルスケア
ニューージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,634.89 7銘柄	1,106 <0.1%>	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)				
MERLIN ENTERTAINMENT	163	62	9,151	一般消費財・サービス
TUI AG-DI	109.47	193	28,328	一般消費財・サービス
BP PLC	4,884	2,859	419,386	エネルギー
UNILEVER PLC	306.6	1,236	181,370	生活必需品
BARCLAYS PLC	4,230	848	124,446	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	417	368	53,989	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	421	129	18,955	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	22.8	135	19,875	素材
PRUDENTIAL PLC	640	1,193	175,006	金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	873.91	230	33,784	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	49.64	189	27,832	素材
BAE SYSTEMS PLC	787	512	75,116	資本財・サービス
AVIVA PLC	985.66	509	74,735	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,221.52	1,930	283,089	ヘルスケア
INFORMA PLC	320	267	39,168	一般消費財・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	105	143	21,058	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,195	287	42,149	資本財・サービス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	93	52	7,695	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	224	94	13,866	情報技術
DCC PLC	21.5	155	22,860	資本財・サービス
GVC HOLDINGS PLC	140	144	21,251	一般消費財・サービス
CONVATEC GROUP PLC	330	75	11,029	ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC	223	112	16,522	資本財・サービス
NMC HEALTH PLC	27	99	14,587	ヘルスケア
RELX PLC	267.46	430	63,133	資本財・サービス
DIAGEO PLC	618	1,714	251,378	生活必需品
RIO TINTO PLC	300.5	1,322	194,001	素材
STANDARD CHARTERED PLC	813	594	87,148	金融
TESCO PLC	2,458	614	90,050	生活必需品
FRESNILLO PLC	56	67	9,904	素材
SMITH & NEPHEW PLC	221	301	44,161	ヘルスケア
GLENCORE PLC	3,066.25	1,221	179,203	素材
WOOD GROUP (JOHN) PLC	162	104	15,253	エネルギー

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	68	141	20,823	金融
SMITHS GROUP PLC	102.33	184	27,028	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	61	52	7,661	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	334.83	119	17,521	金融
PEARSON PLC	201.63	178	26,117	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	410.25	129	18,934	生活必需品
NEXT PLC	35.5	219	32,248	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	842	158	23,228	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	46.11	192	28,206	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	82.55	193	28,450	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	6,676.83	1,255	184,152	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	31.93	158	23,231	素材
KINGFISHER PLC	554.11	174	25,558	一般消費財・サービス
WPP PLC	313	384	56,462	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	171.27	134	19,748	公益事業
SEVERN TRENT PLC	57.33	107	15,807	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	167.5	1,030	151,078	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	136	168	24,742	金融
SCHROEDERS PLC	30.5	99	14,653	金融
SSE PLC	251	341	50,063	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	61.5	127	18,670	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	259	145	21,347	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	314.5	1,713	251,286	ヘルスケア
FERGUSON PLC	58.87	360	52,908	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,465	400	58,698	金融
3I GROUP PLC	238.91	234	34,323	金融
SKY PLC	255	344	50,487	一般消費財・サービス
ASHTREAD GROUP PLC	127	302	44,403	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	276.14	187	27,555	情報技術
NATIONAL GRID PLC	842.34	702	103,067	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	17,859.65	1,127	165,356	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	262.6	172	25,341	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	234.5	611	89,693	生活必需品
CENTRICA PLC	1,436.6	220	32,288	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	32	134	19,706	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	567.1	2,117	310,601	生活必需品
BHP BILLITON PLC	519.77	908	133,310	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	91	250	36,715	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	4,977	3,656	536,204	金融
SHIRE PLC	225.74	918	134,729	ヘルスケア
OLD MUTUAL PLC	1,225.25	278	40,772	金融
ANGLO AMERICAN PLC	328.83	589	86,488	素材
MONDI PLC	93.5	195	28,618	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	549	135	19,823	生活必需品
CARNIVAL PLC	45.11	215	31,583	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	40	71	10,536	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	394.39	636	93,413	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	79	215	31,595	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	2,134	456	67,007	電気通信サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	44	115	16,971	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	104.89	226	33,273	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	46.36	229	33,615	一般消費財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC	59	84	12,386	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	40.5	236	34,628	資本財・サービス
ITV PLC	931	162	23,846	一般消費財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	78.99	354	52,015	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,126	2,936	430,600	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	933.18	2,529	370,959	エネルギー
MEGGITT PLC	195	97	14,345	資本財・サービス
G4S PLC	378	105	15,494	資本財・サービス
ADMIRAL GROUP PLC	49.5	94	13,851	金融
INVESTEC PLC	160	91	13,398	金融
ANTOFAGASTA PLC	98	104	15,306	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	671.57	237	34,787	金融
EXPERIAN PLC	226.54	426	62,528	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 >	76,461.81 98銘柄	49,091 <7.0%>	7,199,763
(イスラエル)		百株	千イスラエル・シェケル	千円
AZRIELI GROUP LTD	10	184	5,646	不動産
FRUTAROM	9	316	9,705	素材
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	483	193	5,915	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD	176	313	9,592	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	6	266	8,164	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	266	663	20,313	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	354	786	24,074	金融
NICE LTD	14	555	17,018	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	30	201	6,159	金融
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,348 9銘柄	3,481 <0.1%>	106,590

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2018年6月15日現在		業種等	
		評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
		百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
DUFREY AG-REG	8.5	118	13,166		一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	977	1,539	170,789		金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	131	14,574		素材
ADECCO GROUP AG-REG	39	237	26,318		資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	177	3,740	414,841		ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	9.5	85	9,515		金融
SIKA AG-REG	31.8	465	51,603		素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.03	226	25,156		生活必需品
ABB LTD-REG	459	1,072	118,981		資本財・サービス
SWISS RE AG	77.5	690	76,541		金融
NESTLE SA-REG	770.5	5,749	637,731		生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	4.2	312	34,613		金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	9.7	215	23,885		資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	651.2	1,018	113,005		金融
JULIUS BAER GROUP LTD	55.5	340	37,724		金融
SGS SA-REG	1.3	346	38,428		資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	5	108	12,079		資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	12	195	21,675		ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	15.5	239	26,528		情報技術
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7.9	393	43,646		一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	38.02	1,142	126,684		金融
BALOISE HOLDING AG - REG	12	179	19,925		金融
CLARIANT AG-REG	57	141	15,673		素材
NOVARTIS AG-REG	553.5	4,178	463,526		ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.6	108	12,072		生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	131	1,212	134,465		一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	6.6	294	32,650		電気通信サービス
GEBERIT AG-REG	9.1	402	44,594		資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	2.3	519	57,656		素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2.7	207	23,015		ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	13	226	25,090		ヘルスケア
LONZA GROUP AG-REG	18.3	503	55,820		ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	13	117	13,049		一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	113.9	594	65,973		素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	8.2	289	32,061		金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	13.5	207	23,007		資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	18.5	171	18,970		不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.25	158	17,580		生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,325.6 38銘柄	27,881	3,092,627 <3.0%>	
(デンマーク)		百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	464	13,265	227,773		ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	188	4,119	70,724		金融
ISS A/S	39	867	14,892		資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.95	881	15,128		資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	17	780	13,409		ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52.5	2,174	37,337		資本財・サービス
CARLSBERG AS-B	26	1,922	33,017		生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	58	1,902	32,674		素材
COLOPLAST-B	29.5	1,883	32,346		ヘルスケア
DSV A/S	47.5	2,575	44,220		資本財・サービス
WILLIAM DEMANT HOLDING	26.75	691	11,868		ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1.6	1,589	27,285		資本財・サービス
TRYG A/S	25	376	6,464		金融
PANDORA A/S	27.5	1,343	23,070		一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	25.5	1,663	28,555		素材
GENMAB A/S	14	1,382	23,744		ヘルスケア
ORSTED A/S	47	1,762	30,254		公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,089.8 17銘柄	39,182	672,766 <0.6%>	
(ノルウェー)		百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA	352	1,869	25,420		素材
DNB ASA	239.5	3,798	51,659		金融
ORKLA ASA	208.5	1,525	20,745		生活必需品
TELENOR ASA	186	3,175	43,180		電気通信サービス
EQUINOR ASA	284.23	6,218	84,577		エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	41.6	1,440	19,592		素材
MARINE HARVEST	99	1,695	23,063		生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	48.5	627	8,535		金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	24	589	8,013		一般消費財・サービス
AKER BP ASA	29	883	12,013		エネルギー
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,512.33 10銘柄	21,823	296,800 <0.3%>	
(スウェーデン)		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB	19	520	6,580		生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	781.3	5,326	67,332		情報技術
VOLVO AB-B SHS	391	5,859	74,059		資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	15	825	10,428		電気通信サービス
SKF AB-B SHARES	97.5	1,679	21,234		資本財・サービス

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ELECTROLUX AB-SER B	59.5	1,300	16,432	一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB	748	6,404	80,951	金融
SWEDISH MATCH AB	46	1,951	24,670	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	89.5	1,038	13,128	電気通信サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	386.5	3,210	40,577	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	374.5	3,703	46,806	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	224	4,251	53,739	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	235.5	3,298	41,691	一般消費財・サービス
SKANSKA AB-B SHS	83.5	1,338	16,913	資本財・サービス
SANDVIK AB	284.5	4,455	56,314	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	113.5	4,241	53,612	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	165.5	4,616	58,354	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	74	1,075	13,600	資本財・サービス
TELIA CO AB	716	3,074	38,861	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB	70	1,571	19,863	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	97	2,459	31,093	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	249	4,757	60,130	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	18	514	6,497	金融
LUNDIN PETROLEUM AB	46.5	1,319	16,680	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	150	3,231	40,839	生活必需品
BOLIDEN AB	65	1,986	25,103	素材
EPIROC AB-A	165.5	1,387	17,540	その他
EPIROC AB-B	97	781	9,876	その他
HUSQVARNA AB-B SHS	97.5	857	10,842	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B	56.5	1,791	22,646	金融
HEXAGON AB-B SHS	65	3,346	42,295	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	40	739	9,343	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,121.3 32銘柄	82,914 <1.0%>	
ユーロ (アイルランド)	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	60	208	26,644	素材
AIB GROUP PLC	200	99	12,687	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC	236.6	166	21,334	金融
KERRY GROUP PLC-A	39.7	354	45,368	生活必需品
CRH PLC	208.5	680	86,988	素材
PADDY POWER BETFAIR PLC	20.5	200	25,695	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	765.3 6銘柄	1,710 <0.2%>	
ユーロ (オランダ)	百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N. V.	55.98	180	23,061	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	237.26	876	112,141	ヘルスケア
NN GROUP NV	76	280	35,858	金融
UNILEVER NV-CVA	403	1,880	240,502	生活必需品
HEINEKEN NV	63.5	558	71,486	生活必需品
RELX NV	237.19	433	55,409	資本財・サービス
AEGON NV	447.44	242	31,074	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	319.83	653	83,591	生活必需品
AKZO NOBEL	63	481	61,528	素材
KONINKLIJKE DSM NV	45.5	410	52,479	素材
WOLTERS KLUWER	73	351	44,965	資本財・サービス
ING GROEP NV	972.5	1,237	158,239	金融
KONINKLIJKE KPN NV	842.5	203	25,979	電気通信サービス
ASML HOLDING NV	98.5	1,828	233,821	情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA	103	237	30,325	金融
VOPAK	19	79	10,133	エネルギー
RANDSTAD NV	28.5	152	19,486	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	28.5	242	30,983	生活必需品
AIRBUS SE	144.5	1,510	193,243	資本財・サービス
EXOR NV	26.8	165	21,190	金融
CNH INDUSTRIAL NV	252	255	32,633	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	266.5	486	62,164	一般消費財・サービス
FERRARI NV	31.45	400	51,165	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,835.45 23銘柄	13,146 <1.6%>	
ユーロ (ベルギー)	百株	千ユーロ	千円	
UCB SA	32.5	215	27,600	ヘルスケア
KBC GROUP NV	62	415	53,082	金融
COLRUYT SA	16	73	9,405	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	20	187	24,019	金融
SOLVAY SA	18	204	26,106	素材
UMICORE	51	260	33,266	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	190	1,596	204,201	生活必需品
AGEAS	45.4	200	25,648	金融
PROXIMUS	35	76	9,745	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	12	49	6,360	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	481.9 10銘柄	3,279 <0.4%>	

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ルクセンブルグ)				
RTL GROUP	10	65	8,383	一般消費財・サービス
ARCELORMITTAL	169	490	62,781	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	2.7	113	14,469	ヘルスケア
SES	90	140	17,962	一般消費財・サービス
TENARIS SA	112.5	177	22,691	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	384.2 5銘柄	987 <0.1%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フランス)				
JCDECAUX SA	19	53	6,789	一般消費財・サービス
TOTAL SA	604.5	3,195	408,689	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	42.5	469	60,065	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	107.02	1,199	153,440	素材
KERING	18.8	967	123,736	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	141	1,067	136,516	資本財・サービス
BOUYGUES SA	52.5	204	26,100	資本財・サービス
BNP PARIBAS	278	1,524	194,990	金融
PEUGEOT SA	145	309	39,539	一般消費財・サービス
NATIXIS	229.5	146	18,756	金融
THALES SA	26.8	296	37,944	資本財・サービス
DANONE	151.5	984	125,930	生活必需品
CARREFOUR SA	149	231	29,595	生活必需品
SUEZ	88.75	102	13,110	公益事業
VIVENDI	254.41	557	71,260	一般消費財・サービス
L'OREAL	63	1,329	170,098	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	125	518	66,356	資本財・サービス
LEGRAND SA	65.67	426	54,561	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	13	44	5,703	生活必需品
PERNOD RICARD SA	54.17	784	100,391	生活必需品
SOCIETE BIC SA	7	55	7,153	資本財・サービス
EURAZEO SA	10.45	70	8,974	金融
REXEL SA	70.5	94	12,046	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA	193.5	724	92,708	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	69	2,087	267,003	一般消費財・サービス
ACCOR SA	46.5	207	26,560	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	39.9	470	60,217	情報技術
VALEO SA	59.5	317	40,592	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	52.5	311	39,872	一般消費財・サービス
BUREAU VERITAS SA	65	151	19,436	資本財・サービス
EIFPAGE	18.2	175	22,430	資本財・サービス
SODEXO SA	23	197	25,216	一般消費財・サービス
IPSEN	9	123	15,781	ヘルスケア
INGENICO GROUP	16	122	15,650	情報技術
AMUNDI SA	15	94	12,144	金融
TELEPERFORMANCE	14	195	25,032	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	20	199	25,513	情報技術
FAURECIA	19	136	17,501	一般消費財・サービス
SEB SA	5.6	85	10,936	一般消費財・サービス
ESSILOR INTERNATIONAL	52	629	80,574	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA	0.6	102	13,076	資本財・サービス
AXA SA	482	1,052	134,607	金融
EDENRED	59.5	163	20,874	資本財・サービス
RENAULT SA	47	398	50,993	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	7.8	430	55,008	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	5.5	69	8,898	生活必需品
ATOS SE	23.5	289	37,044	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA	32	396	50,730	情報技術
WENDEL	6.8	85	10,906	金融
ORANGE	502.5	735	94,090	電気通信サービス
ALSTOM	40.5	163	20,854	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	43	85	10,872	金融
SANOFI	281.75	1,897	242,629	ヘルスケア
VINCI SA	127	1,089	139,367	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	136.5	266	34,061	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	281	338	43,307	金融
BIOMERIEUX	10	81	10,475	ヘルスケア
ENGIE	461.73	641	82,057	公益事業
IMERYS SA	9	64	8,218	素材
EDF	139.5	161	20,607	公益事業
SAFRAN SA	83	864	110,562	資本財・サービス
ILIAD SA	6.5	92	11,801	電気通信サービス
ARKEMA	16.5	171	21,926	素材
ADP	7.4	144	18,418	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	40.5	71	9,168	一般消費財・サービス
SCOR SE	41.5	134	17,154	金融
GETLINK	112.5	137	17,539	資本財・サービス
BOLLORE	213	88	11,354	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,652.85 68銘柄	31,083 <3.8%>	

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ドイツ)				
BAYER AG-REG	205	2,066	264,292	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	42.5	131	16,839	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	506.5	489	62,559	金融
COMMERZBANK AG	263.35	244	31,314	金融
VOLKSWAGEN AG	8	130	16,678	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	46.2	754	96,517	一般消費財・サービス
MAN SE	8.5	79	10,126	資本財・サービス
SIEMENS AG-REG	189	2,281	291,769	資本財・サービス
E.ON SE	545	505	64,630	公益事業
UNIPER SE	49	125	16,031	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	82.5	711	91,029	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	45	144	18,434	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG	25.6	132	16,993	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	27	595	76,145	一般消費財・サービス
BASF SE	227.5	2,003	256,259	素材
K+S AG-REG	48	110	14,071	素材
ALLIANZ SE-REG	110.1	2,015	257,781	金融
THYSSENKRUPP AG	107	253	32,420	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	44.5	489	62,663	生活必需品
RWE AG	131.5	263	33,738	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	56.5	134	17,227	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	10	85	10,871	資本財・サービス
BRENTAG AG	39.5	199	25,482	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	105	744	95,268	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	30	174	22,285	情報技術
HOCHTIEF AG	4.5	72	9,220	資本財・サービス
SAP SE	243.42	2,538	324,721	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	38.3	710	90,917	金融
SCHAEFFLER AG	38	49	6,320	一般消費財・サービス
ZALANDO SE	29	138	17,662	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	37	287	36,779	素材
KION GROUP AG	18.5	134	17,159	資本財・サービス
WIRECARD AG	29.5	461	58,972	情報技術
COVESTRO AG	49	380	48,632	素材
INNOGY SE	34	125	16,002	公益事業
SARTORIUS AG-VORZUG	9.5	126	16,160	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	37.5	236	30,273	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO AG	25	102	13,109	情報技術
METRO AG	41	46	5,978	生活必需品
1&1 DRILLISCH AG	13	83	10,716	電気通信サービス
LINDE AG - TENDER	46.3	968	123,883	素材
SIEMENS HEALTHINEERS AG	40	143	18,358	ヘルスケア
BEIERSDORF AG	25.5	253	32,405	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF	17	78	10,088	素材
MERCK KGAA	32.5	273	34,974	ヘルスケア
ADIDAS AG	46.6	926	118,457	一般消費財・サービス
PUMA SE	1.56	78	10,075	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	26.5	260	33,334	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	831	1,150	147,204	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	53	468	59,977	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	238.5	1,507	192,755	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	287.5	732	93,729	情報技術
HANNOVER RUECK SE	15	167	21,468	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	244.5	742	94,940	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	49	570	72,949	金融
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	59.5	144	18,454	一般消費財・サービス
LANXESS AG	22	158	20,332	素材
MTU AERO ENGINES AG	13.3	221	28,339	資本財・サービス
AXEL SPRINGER SE	12	73	9,454	一般消費財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	88.5	365	46,714	不動産
SYMRISE AG	30	225	28,831	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	188	69	8,829	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	13.5	100	12,854	一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD	15.9	127	16,272	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	121	502	64,224	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,118.13 65銘柄	30,672 <3.8%>	3,922,975
ユーロ (ポルトガル)				
JERONIMO MARTINS	60	80	10,260	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	565	192	24,569	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	116.5	188	24,108	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	741.5 3銘柄	460 <0.1%>	58,938
ユーロ (スペイン)				
TELEFONICA SA	1,149.27	867	110,963	電気通信サービス
ENDESA SA	76.5	149	19,084	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,664.12	1,014	129,705	金融
IBERDROLA SA	1,462.34	973	124,564	公益事業

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2018年6月15日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ユーロ	千円		
BANCO DE SABADELL SA	1,309.09	192	24,595	金融	
BANKINTER SA	166	144	18,424	金融	
REPSOL SA	338.5	582	74,552	エネルギー	
GRIFOLS SA	72	198	25,425	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	4,057.5	1,942	248,397	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	110	794	101,634	情報技術	
GAS NATURAL SDG SA	84.5	184	23,549	公益事業	
MAPFRE SA	254.5	65	8,407	金融	
CAIXABANK S. A	888	342	43,805	金融	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	152	124	15,922	資本財・サービス	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	61.76	227	29,068	資本財・サービス	
AENA SME SA	17	272	34,799	資本財・サービス	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	274.5	824	105,430	一般消費財・サービス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	56	73	9,418	資本財・サービス	
ENAGAS SA	54	132	16,934	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	107	191	24,489	公益事業	
FERROVIAL SA	123	226	28,993	資本財・サービス	
BANKIA SA	301.05	101	13,045	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,778.63 22 銘柄	9,626	1,231,215 <1.2% >	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (イタリア)					
PRYSMIAN SPA	53.5	137	17,585	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	313.43	461	59,069	金融	
MEDIOBANCA SPA	152.65	124	15,943	金融	
UNICREDIT SPA	492.56	715	91,473	金融	
TELECOM ITALIA SPA	2,827.82	193	24,738	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	1,469.5	88	11,273	電気通信サービス	
INTESA SANPAOLO-RSP	210	56	7,225	金融	
INTESA SANPAOLO	3,360.97	871	111,507	金融	
ATLANTIA SPA	114.07	287	36,707	資本財・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	135	105	13,502	金融	
MONCLER SPA	47	198	25,355	一般消費財・サービス	
RECORDATI SPA	26	86	11,073	ヘルスケア	
ENI SPA	638	1,008	129,042	エネルギー	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	143	99	12,665	生活必需品	
PIRELLI & C SPA	110	81	10,411	一般消費財・サービス	
LEONARDO SPA	95.25	85	10,961	資本財・サービス	
ENEL SPA	2,019.34	984	125,856	公益事業	
SNAM SPA	566	204	26,155	エネルギー	
LUXOTTICA GROUP SPA	41	227	29,135	一般消費財・サービス	
TERNA SPA	349	162	20,783	公益事業	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	13,164.09 20 銘柄	6,180	790,466 <0.8% >	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フィンランド)					
UPM-KYMMENE OYJ	130	414	52,956	素材	
NOKIA OYJ	1,467.5	768	98,313	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP	108	189	24,249	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS	138	244	31,320	素材	
METSO OYJ	28	86	11,101	資本財・サービス	
ELISA OYJ	36.5	143	18,327	電気通信サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	111	469	59,996	金融	
FORTUM OYJ	111.5	226	28,949	公益事業	
KONE OYJ-B	82	365	46,744	資本財・サービス	
NOKIAN RENKAAT OYJ	30.5	106	13,567	一般消費財・サービス	
NESTE OYJ	31.5	211	26,993	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	24.5	59	7,652	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,299 12 銘柄	3,285	420,172 <0.4% >	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オーストリア)					
OMV AG	35.5	179	22,965	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	74	268	34,347	金融	
VOESTALPINE AG	28.5	127	16,308	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	34	95	12,176	金融	
ANDRITZ AG	16	70	8,991	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	188 5 銘柄	741	94,788 <0.1% >	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (その他)					
STMICROELECTRONICS NV	173.5	392	50,239	情報技術	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	173.5 1 銘柄	392	50,239 <0.0% >	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	48,582.55 240 銘柄	101,565	12,990,246 <12.5% >	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	278,150.8 1,253 銘柄	—	99,506,241 <96.1% >	

(注1) 邦貨換算金額は、2018年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄		2018年6月15日現在		
		□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC		3.447	579	64,163
SIMON PROPERTY GROUP INC		7.687	1,261	139,573
BOSTON PROPERTIES INC		3.75	449	49,756
GGP INC		16.7	346	38,316
VORNADO REALTY TRUST		4.047	291	32,223
SBA COMMUNICATIONS CORP		2.85	447	49,523
EQUITY RESIDENTIAL		8.85	564	62,444
EQUINIX INC		1.918	760	84,221
AMERICAN TOWER CORP		10.85	1,501	166,141
HOST HOTELS & RESORTS INC		18.593	396	43,894
KIMCO REALTY CORP		10	165	18,295
INVITATION HOMES INC		7.4	165	18,362
VENTAS INC		8.7	473	52,392
WEYERHAEUSER CO		18.264	680	75,319
AGNC INVESTMENT CORP		9.9	188	20,818
CROWN CASTLE INTL CORP		9.8	991	109,735
IRON MOUNTAIN INC		6.76	229	25,431
VEREIT INC		24.4	176	19,552
PROLOGIS INC		13.062	841	93,132
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		2.37	302	33,486
CAMDEN PROPERTY TRUST		2.35	211	23,450
DUKE REALTY CORP		8.7	248	27,491
ESSEX PROPERTY TRUST INC		1.58	371	41,065
FEDERAL REALTY INVS TRUST		1.85	224	24,794
WELLTOWER INC		9.2	530	58,692
HCP INC		11.3	269	29,853
LIBERTY PROPERTY TRUST		3.6	159	17,643
MID-AMERICA APARTMENT COMM		2.75	266	29,484
MACERICH CO/THE		2.9	162	18,012
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		28.1	295	32,718
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		3.75	158	17,502
REALTY INCOME CORP		6.75	357	39,588
PUBLIC STORAGE		3.85	825	91,385
REGENCY CENTERS CORP		3.7	222	24,575
SL GREEN REALTY CORP		2.4	234	25,989
UDR INC		6.8	252	27,922
DIGITAL REALTY TRUST INC		4.95	527	58,418
EXTRA SPACE STORAGE INC		3	292	32,383
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	296,878 38銘柄	16,423	1,817,757 <1.8%>
(カナダ)		千口	千カナダ・ドル	千円
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		1.5	45	3,823
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		3.7	74	6,277
RIOCAN REAL ESTATE INVSTR		3.9	93	7,853
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	9.1 3銘柄	212	17,955 <0.0%>
(オーストラリア)		千口	千オーストラリア・ドル	千円
LENLEASE GROUP		14.9	281	23,241
TRANSURBAN GROUP		55.4	660	54,500
SYDNEY AIRPORT		27.5	199	16,499
APA GROUP		29.2	280	23,158
SCENTRE GROUP		135.822	571	47,191
DEXUS		25.85	248	20,480
GPT GROUP		44.06	220	18,217
MIRVAC GROUP		91.4	203	16,821
STOCKLAND		61.5	255	21,063
GOODMAN GROUP		43.9	416	34,382
VICINITY CENTRES		83.173	219	18,121
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	612,705 11銘柄	3,558	293,679 <0.3%>
(香港)		千口	千香港ドル	千円
LINK REIT		54.5	3,891	54,867
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		64.5	480	6,775
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		99	991	13,986
香港ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	218 3銘柄	5,363	75,629 <0.1%>
(シンガポール)		千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		60.1	98	8,101
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		62.5	163	13,460
CAPITALAND MALL TRUST		63.2	128	10,545
SUNTEC REIT		63	107	8,803
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	248.8 4銘柄	497	40,911 <0.0%>

銘柄	数	2018年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	18.062	172	25,263
SEGRO PLC	25.75	172	25,302
HAMMERSON PLC	19.2	102	15,076
BRITISH LAND CO PLC	23.4	161	23,748
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	86.412 4 銘柄	609 <0.1% >
(ユーロ (フランス))	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL GROUP STAPLED	3.46	662	84,745
ICADE	0.8	65	8,410
GECINA SA	1.25	179	22,958
KLEPIERRE	5.65	188	24,121
COVIVIO	0.85	76	9,740
ユーロ通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	12.01 5 銘柄	1,172 <0.1% >
ファンド合計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,483.905 68 銘柄	— <2.4% >

(注1) 邦貨換算金額は、2018年6月15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	2018年6月15日現在	
	買建額	売建額
外国 S&P500 E-MINI FUTURE (アメリカ)	百万円 1,543	百万円 —

(注1) 外貨建の評価額は、2018年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第18期 (決算日 2017年11月30日)

(計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

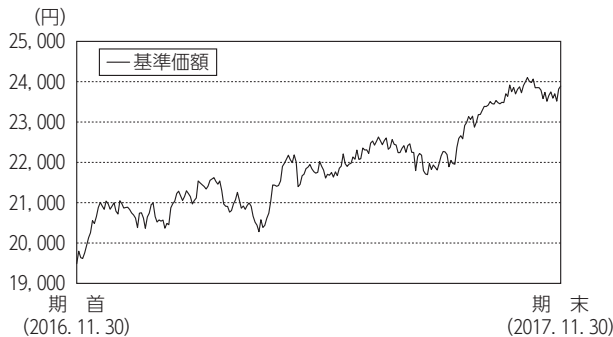
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数(円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の株式(預託証券を含みます。)
運用方法	①主として外国の株式(預託証券を含みます。)に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数(円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
株式組入制限	無制限

大和投資信託

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

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) 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：19,489円 期末：23,891円 騰落率：22.6%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外株式市況

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

○為替相場

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク(MSCIコクサイ指数(円ベース))の騰落率は20.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は22.6%となりました。

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

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

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	アメリカ	百株 3,341.7 (253.89)	千アメリカ・ドル 22,389 (△ 3,456)	百株 4,430.91	千アメリカ・ドル 24,071
	カナダ	百株 607 (11.11)	千カナダ・ドル 2,885 (—)	百株 483.78	千カナダ・ドル 1,615
	オーストラリア	百株 740.5 (△ 1,811.25)	千オーストラリア・ドル 1,299 (△ 1,196)	百株 907	千オーストラリア・ドル 1,128
	香港	百株 1,952 (△ 28.42)	千香港ドル 2,314 (△ 879)	百株 1,665.06	千香港ドル 3,294
	シンガポール	百株 602 (—)	千シンガポール・ドル 190 (—)	百株 877	千シンガポール・ドル 172
	ニュージーランド	百株 35 (—)	千ニュージーランド・ドル 29 (—)	百株 —	千ニュージーランド・ドル —
	イギリス	百株 5,229.5 (△ 2,434.83)	千イギリス・ポンド 2,998 (△ 31)	百株 2,972.1	千イギリス・ポンド 1,962
	イスラエル	百株 45 (—)	千イスラエル・シェケル 609 (—)	百株 146	千イスラエル・シェケル 235
	スイス	百株 265 (30.6)	千スイス・フラン 1,365 (△ 196)	百株 210.96	千スイス・フラン 2,709
	デンマーク	百株 119 (—)	千デンマーク・クローネ 3,015 (—)	百株 50.7	千デンマーク・クローネ 1,613
	ノルウェー	百株 45 (—)	千ノルウェー・クローネ 671 (△ 115)	百株 60	千ノルウェー・クローネ 599
	スウェーデン	百株 230 (155)	千スウェーデン・クローネ 3,578 (△ 11)	百株 393.5	千スウェーデン・クローネ 4,178
	ユーロ (アイルランド)	百株 — (△ 6,397.4)	千ユーロ (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オランダ)	百株 202 (△ 2.02)	千ユーロ 537 (△ 7)	百株 118.8	千ユーロ 343
	ユーロ (ベルギー)	百株 11.8 (22.5)	千ユーロ 104 (—)	百株 19.2	千ユーロ 131
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 24.7 (△ 282)	千ユーロ 149 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (フランス)	百株 398.9 (△ 16.05)	千ユーロ 1,594 (△ 32)	百株 180.4	千ユーロ 1,360
	ユーロ (ドイツ)	百株 450.5 (362.5)	千ユーロ 1,495 (△ 45)	百株 546.9	千ユーロ 1,120

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ユーロ (ポルトガル)	百株 13 (—)	千ユーロ 17 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (スペイン)	百株 987 (△ 1,561.17)	千ユーロ 726 (△ 27)	百株 1,271.23	千ユーロ 337
	ユーロ (イタリア)	百株 1,265 (△ 2,185.15)	千ユーロ 905 (△ 25)	百株 751.68	千ユーロ 407
	ユーロ (フィンランド)	百株 139.5 (—)	千ユーロ 118 (—)	百株 115	千ユーロ 113
	ユーロ (オーストリア)	百株 10 (—)	千ユーロ 27 (△ 6)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (その他)	百株 — (51)	千ユーロ — (—)	百株 58	千ユーロ 174
ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 3,502.4 (△ 10,007.79)	千ユーロ 5,677 (△ 144)	百株 3,061.21	千ユーロ 3,989	

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	9,535	9,134	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
株 式

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国株式

銘 柄	期 首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)					
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	27	27	240	26,961	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	21	21	304	34,095	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	14.5	13.5	186	20,855	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	196	188	664	74,466	金融
ABBOTT LABORATORIES	341	396.16	2,201	246,718	ヘルスケア
ARCONIC INC	103.33	89.33	215	24,092	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	37.5	35	332	37,248	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	101	92	621	69,644	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	72	69.5	623	69,908	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	71.79	75.79	702	78,740	情報技術
QORVO INC	32	29	222	24,920	情報技術
AFLAC INC	97	92	802	89,880	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	27.5	27.5	233	26,133	一般消費財・サービス
ADOBE SYSTEMS INC	114.5	113.5	2,007	224,912	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	50	55	202	22,709	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	25	25	167	18,731	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	68	80	154	17,264	金融
GARMIN LTD	26	29	180	20,276	一般消費財・サービス
AETNA INC	80.79	75.79	1,360	152,495	ヘルスケア
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	47.5	50.5	821	92,018	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	166	165	2,528	283,313	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	37.51	37.51	271	30,400	情報技術
WR BERKLEY CORP	21	23	157	17,653	金融
AUTOZONE INC	6.7	6.3	434	48,631	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	55.71	53.21	554	62,090	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	209	209	314	35,291	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	26.5	26.5	241	27,023	公益事業
CELANESE CORP-SERIES A	33	33	352	39,520	素材
DR HORTON INC	79.66	83.16	421	47,205	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	21	21	96	10,835	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	55	52	355	39,830	ヘルスケア
AUTODESK INC	45.5	45.5	497	55,744	情報技術
MOODY'S CORP	40.5	40	599	67,158	金融
DEVON ENERGY CORP	109	117.5	435	48,845	エネルギー
ALBEMARLE CORP	26	26	343	38,440	素材
ATMOS ENERGY CORP	23	25	226	25,354	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	50	54	242	27,167	公益事業
CITIGROUP INC	661.23	628.23	4,714	528,230	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	106	103	1,167	130,795	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	115	114	879	98,536	公益事業
ALLEGHANY CORP	3.5	3.5	204	22,912	金融
DUN & BRADSTREET CORP	9	—	—	—	資本財・サービス
DOMINO'S PIZZA INC	11	11	197	22,083	一般消費財・サービス
HESS CORP	65	65	291	32,636	エネルギー
DAVITA INC	38	35	212	23,781	ヘルスケア
DANAHER CORP	142.5	142	1,333	149,468	ヘルスケア
FORTIVE CORP	72	72	528	59,232	資本財・サービス
AVNET INC	28	28	115	12,938	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	135	135	942	105,584	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	40	40	54	6,082	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	40.28	40.28	49	5,497	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	134	129	513	57,485	生活必需品
BUNGE LTD	31	31	205	23,071	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	82.25	82.25	775	86,861	情報技術
APPLE INC	1,239	1,189	20,151	2,257,938	情報技術

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	94	86	593	66,500	金融
BOEING CO/THE	135	130.5	3,514	393,784	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	34.65	34.65	259	29,068	金融
SPECTRA ENERGY CORP	159.96	—	—	—	その他
BECTON DICKINSON AND CO	48.87	51.87	1,176	131,863	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	—	60	155	17,378	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	—	33	205	23,069	情報技術
CDK GLOBAL INC	29	29	200	22,424	情報技術
NISOURCE INC	73	73	198	22,224	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	33.5	33.5	283	31,714	資本財・サービス
CR BARD INC	16.8	16.8	565	63,402	ヘルスケア
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	250.71	236.71	1,287	144,313	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	936.04	934.04	4,660	522,249	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	275.5	285.5	5,420	607,335	金融
ANSYS INC	21	19	278	31,206	情報技術
H&R BLOCK INC	51	51	131	14,783	一般消費財・サービス
BB&T CORP	190	187.5	921	103,198	金融
BAKER HUGHES INC	95.73	—	—	—	その他
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	387	378.5	2,380	266,764	ヘルスケア
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	13	—	—	—	生活必需品
JPMORGAN CHASE & CO	826.7	813.2	8,435	945,178	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	56	56	567	63,544	金融
CIGNA CORP	59	59	1,214	136,073	ヘルスケア
LKQ CORP	68	72	284	31,867	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	10	10	136	15,288	金融
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	258.42	—	—	—	電気通信サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	50	45.5	269	30,181	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	69	64	276	30,950	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	39.6	34.6	565	63,411	金融
DOLLAR GENERAL CORP	65	62	549	61,606	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	38	39.5	476	53,372	情報技術
CATERPILLAR INC	134	135	1,863	208,839	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	64	64	317	35,576	公益事業
MOSAIC CO/THE	75.5	75.5	184	20,633	素材
DELTA AIR LINES INC	44	44	229	25,686	資本財・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	43.5	—	—	—	その他
CORNING INC	247	213	691	77,518	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,159	1,141	4,276	479,178	情報技術
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	200	—	—	—	その他
MORGAN STANLEY	333	318	1,631	182,862	金融
WABCO HOLDINGS INC	12.5	12.5	187	20,985	資本財・サービス
DOW CHEMICAL CO/THE	258	—	—	—	その他
MSCI INC	22	21.5	274	30,771	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	—	9	183	20,555	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	—	13	162	18,254	資本財・サービス
COTY INC-CL A	111.39	111.39	190	21,330	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	—	41	168	18,831	情報技術
BROADCOM LTD	90.62	91.52	2,484	278,418	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	10.5	10.5	135	15,191	ヘルスケア
DICK'S SPORTING GOODS INC	20	20	58	6,601	一般消費財・サービス
ACUITY BRANDS INC	10	10	170	19,098	資本財・サービス
ARAMARK	53.5	58.5	249	27,910	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	49	49	183	20,616	素材
DTE ENERGY COMPANY	42	41.5	475	53,271	公益事業
CENTENE CORP	40	40	396	44,376	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	—	24	290	32,520	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	122	116	471	52,862	金融
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	43	—	—	—	その他
ARTHUR J GALLAGHER & CO	40.5	40.5	269	30,141	金融
GARTNER INC	19	21	250	28,074	情報技術
SPLUNK INC	29	32	254	28,501	情報技術
WHITEWAVE FOODS CO	41	—	—	—	その他
AGCO CORP	17	14.5	102	11,519	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC	143	143	1,201	134,594	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	93	93	575	64,493	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	34	34	212	23,810	資本財・サービス
DEERE & CO	62	61.5	912	102,291	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	36	36	356	39,918	情報技術
TIME WARNER INC	176.33	176.33	1,603	179,637	一般消費財・サービス
VMWARE INC-CLASS A	19	16.5	197	22,078	情報技術
TEGNA INC	45	—	—	—	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	27	27	212	23,767	金融
VAIL RESORTS INC	—	9.5	212	23,826	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	—	34	209	23,452	金融
TARGA RESOURCES CORP	—	50.5	210	23,613	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	—	15	246	27,592	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	18	189	21,231	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	70	70	618	69,336	公益事業
MEDNAX INC	20	22	110	12,369	ヘルスケア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	26	24	269	30,191	一般消費財・サービス
TELEFLEX INC	—	10	264	29,627	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	21	21	228	25,563	資本財・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	—	25	147	16,493	ヘルスケア

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	—	17.5	115	12,914	資本財・サービス
IDEX CORP	—	18	238	26,723	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	194.5	191.5	1,378	154,515	生活必需品
ROLLINS INC	—	22	101	11,366	資本財・サービス
AMETEK INC	52.25	52.25	374	41,965	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	58	58	271	30,408	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	—	32	133	14,969	資本財・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A	84	79.5	834	93,542	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	101.5	100.5	1,784	199,916	生活必需品
SCANA CORP	31	31	135	15,193	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	12	13.5	268	30,046	金融
WR GRACE & CO	16	16	118	13,230	素材
VALSPAR CORP/THE	17	—	—	—	その他
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	7	6	181	20,302	一般消費財・サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP	76	76	202	22,677	金融
UGI CORP	39	39	187	20,971	公益事業
CUMMINS INC	37	37	608	68,207	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	136	163	1,010	113,255	情報技術
SABRE CORP	46	46	91	10,215	情報技術
CDW CORP/DE	35.5	37.5	258	28,955	情報技術
SIGNATURE BANK	13	13	180	20,208	金融
COSTAR GROUP INC	—	8.5	256	28,749	情報技術
SVB FINANCIAL GROUP	—	12	272	30,519	金融
AMERCO	1.7	1.7	62	7,001	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	—	10	267	29,995	情報技術
HANESBRANDS INC	85	85	172	19,343	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	18	205	22,972	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	122	45.66	349	39,169	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	—	46	167	18,782	情報技術
DEXCOM INC	—	19	112	12,641	ヘルスケア
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	20.5	221	24,842	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	—	22.5	133	14,909	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	17.7	457	51,242	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	12	12	335	37,557	資本財・サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	29.5	—	—	—	不動産
NIELSEN HOLDINGS PLC	85	80	290	32,557	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	439.81	460.81	772	86,538	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	71	68	544	61,061	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	105.5	105.5	307	34,482	エネルギー
T-MOBILE US INC	67.5	68.5	423	47,457	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	25	25	102	11,448	情報技術
COCA-COLA CO/THE	946.5	929.5	4,229	473,884	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	40	40	257	28,868	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	25	25	136	15,303	金融
FMC TECHNOLOGIES INC	49	—	—	—	その他
FRANKLIN RESOURCES INC	87	76	327	36,728	金融
CSX CORP	222	209.5	1,140	127,795	資本財・サービス
FLUOR CORP	33	33	159	17,822	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	23.5	23.5	368	41,346	ヘルスケア
EXPEDIA INC	28.75	28.75	350	39,307	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	20	20	253	28,420	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	92.1	93	10,799	1,210,118	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	—	50	131	14,768	エネルギー
FLOWERVE CORP	29	29	120	13,488	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49	49	570	63,892	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	953.05	971.05	7,988	895,148	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	31	31	144	16,172	情報技術
AES CORP	156	156	165	18,546	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	18	18	353	39,622	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	10	9	200	22,462	金融
EOG RESOURCES INC	126.5	132.5	1,331	149,208	エネルギー
EQT CORP	40.5	40.5	235	26,370	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	42	39	215	24,183	情報技術
AMERISOURCEBERGEN CORP	44	38	321	36,047	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	77.9	72.9	500	56,109	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	851.23	853.23	1,071	120,079	一般消費財・サービス
TESARO INC	—	9	74	8,375	ヘルスケア
MACY'S INC	73.98	68.98	165	18,534	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	34.4	34.4	64	7,273	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	62.87	48.87	157	17,676	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	58.2	51.2	91	10,200	一般消費財・サービス
MOBILEYE NV	39	—	—	—	その他
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	3	3	33	3,703	ヘルスケア
AERCAP HOLDINGS NV	38	38	196	22,030	資本財・サービス
FORTINET INC	31	35	145	16,251	情報技術
MARKEL CORP	3.2	3.2	353	39,575	金融
NEXTERA ENERGY INC	105.5	107	1,688	189,155	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	271.08	318.08	445	49,932	素材
US BANCORP	395	387	2,119	237,457	金融
UNITED RENTALS INC	22	19	299	33,603	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	16	14.5	188	21,098	情報技術
FASTENAL CO	65	65	333	37,319	資本財・サービス
FISERV INC	52	49.5	637	71,394	情報技術

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		
GENERAL ELECTRIC CO	2,056	1,991	3,679	412,273	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	36.5	43.5	240	26,949	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	61.5	56.5	181	20,347	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	319	311	1,362	152,667	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	27.5	27.5	95	10,652	一般消費財・サービス
LINKEDIN CORP - A	26	—	—	—	その他
GENERAL DYNAMICS CORP	60.5	59	1,204	134,975	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	83	81.6	1,969	220,682	金融
ALPHABET INC-CL A	67.6	68.1	7,064	791,583	情報技術
ALPHABET INC-CL C	70.97	71.47	7,301	818,167	情報技術
GENERAL MILLS INC	136	130	732	82,067	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	99.68	99.68	335	37,606	公益事業
GENUINE PARTS CO	35	35	320	35,884	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	82.34	95.34	421	47,175	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	175	175	533	59,728	金融
HARRIS CORP	29.5	27.5	393	44,131	情報技術
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	30	30	147	16,555	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	197.5	198.5	819	91,859	エネルギー
HOME DEPOT INC	281.5	273.5	4,847	543,194	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	14	12.5	127	14,245	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	246	246	356	39,913	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	—	11	263	29,541	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	33	33	364	40,859	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	45	40	195	21,952	一般消費財・サービス
HUMANA INC	35	33	825	92,489	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	68	82	926	103,825	情報技術
HELMERICH & PAYNE	26	26	148	16,617	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	19	36	253	28,357	ヘルスケア
HP INC	407	389	833	93,407	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	377	377	526	59,013	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	45	40	163	18,331	一般消費財・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	39	39	172	19,371	エネルギー
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	21	21	85	9,602	一般消費財・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	28	29	279	31,269	金融
HARMAN INTERNATIONAL	16	—	—	—	その他
KRAFT HEINZ CO/THE	139.53	138.53	1,123	125,870	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	209.5	204.5	3,140	351,847	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	91	91	505	56,611	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	36	36	240	26,974	資本財・サービス
ZOETIS INC	107	114	816	91,472	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	60.29	57.79	497	55,733	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	47	47	225	25,278	エネルギー
ALLEGION PLC	—	22	182	20,445	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	31	31	149	16,707	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	145.23	130.23	407	45,630	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	24.37	—	—	—	一般消費財・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	41.05	61.57	425	47,671	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	82	89	263	29,528	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	27.2	27.2	320	35,859	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	624	614	8,584	961,874	ヘルスケア
ABBVIE INC	373.79	364.29	3,490	391,124	ヘルスケア
HOLOGIC INC	57.5	65.5	276	31,023	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	83.5	81.5	970	108,799	生活必需品
KROGER CO	212	206	502	56,274	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	37	36.5	366	41,041	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	61.5	60	1,924	215,646	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	21	21	376	42,241	情報技術
L BRANDS INC	56	56	294	32,961	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	205	197	1,641	183,875	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	227.5	225.5	1,915	214,670	ヘルスケア
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	69	—	—	—	その他
LAM RESEARCH CORP	37	37	720	80,694	情報技術
RANGE RESOURCES CORP	43	57	102	11,496	エネルギー
JONES LANG LASALLE INC	10	10	151	16,993	不動産
LOEWS CORP	65	65	327	36,656	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	54.49	51.49	394	44,165	金融
MCDONALD'S CORP	194	185.5	3,161	354,243	一般消費財・サービス
3M CO	139	137	3,260	365,365	資本財・サービス
FACEBOOK INC-A	531.5	541.5	9,483	1,062,602	情報技術
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	52.54	48.04	374	41,981	情報技術
MANPOWERGROUP INC	17	15	194	21,817	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	61.5	59.5	980	109,825	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	14	14	291	32,708	素材
CONCHO RESOURCES INC	32.5	34.5	474	53,157	エネルギー
ENVISION HEALTHCARE CORP	—	26.36	83	9,401	ヘルスケア
FIRST DATA CORP- CLASS A	—	103	166	18,662	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	—	43	152	17,032	電気通信サービス
PHILLIPS 66	110	99.5	944	105,814	エネルギー
MURPHY OIL CORP	36	36	101	11,343	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	—	100	275	30,892	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	108	107.5	361	40,532	一般消費財・サービス
MATTEL INC	78	78	142	15,941	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	—	65.38	624	69,976	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	26.5	26.5	270	30,322	生活必需品
MYLAN NV	104.5	104.5	385	43,160	ヘルスケア
METLIFE INC	213.5	208.5	1,116	125,105	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	105	91	202	22,646	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	—	11	257	28,867	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	—	25	124	13,944	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	36.78	38.28	360	40,392	情報技術
MONSANTO CO	100.56	100.56	1,183	132,632	素材
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	6	375	42,048	ヘルスケア
BAKER HUGHES A GE CO	—	91.73	275	30,814	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	29.5	29.5	560	62,846	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	—	19.4	115	12,920	金融
MERCK & CO. INC.	638.71	627.71	3,475	389,374	ヘルスケア
DOWDUPONT INC	—	535.05	3,840	430,337	素材
MASCO CORP	74	74	311	34,850	資本財・サービス
M & T BANK CORP	33.69	31.69	535	60,048	金融
MARSH & MCLENNAN COS	121.5	117.5	982	110,066	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	75.22	74.72	945	105,902	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	26.5	29.5	314	35,216	情報技術
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	39.5	35.5	208	23,329	一般消費財・サービス
VANTIV INC - CL A	35.5	38.5	278	31,168	情報技術
NETAPP INC	67	61.5	345	38,748	情報技術
NIKE INC -CL B	305.5	300.5	1,813	203,238	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	67.5	67	913	102,407	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	48.5	53.5	463	51,901	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	30	30	265	29,715	金融
ALLY FINANCIAL INC	102	102	271	30,469	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	39.5	38.3	1,174	131,616	資本財・サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	62	62	632	70,895	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	120	120	439	49,212	素材
MCKESSON CORP	51.5	49	725	81,324	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	64	64	333	37,369	情報技術
XYLEM INC	42	42	286	32,095	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	358.5	356	3,655	409,588	生活必需品
NUCOR CORP	71.5	74	424	47,561	素材
WESTERN UNION CO	113.46	113.46	223	25,044	情報技術
NEWELL BRANDS INC	101.42	108.92	332	37,235	一般消費財・サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	175.5	174	1,216	136,281	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	26	25.5	223	25,092	一般消費財・サービス
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	—	6	69	7,736	生活必需品
PAYCHEX INC	75.5	75.5	502	56,325	情報技術
PATTERSON COS INC	19	19	70	7,866	ヘルスケア
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	22	21.2	500	56,136	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	450.5	442.5	2,981	334,034	生活必需品
P G & E CORP	115	116	638	71,565	公益事業
PFIZER INC	1,396.63	1,363.63	4,937	553,269	ヘルスケア
ALKERMES PLC	36	36	185	20,753	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	115	115	589	66,052	公益事業
STRYKER CORP	78.5	76.5	1,178	132,091	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	30.5	30.5	562	62,991	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	37.5	39	589	66,056	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	14	14	180	20,245	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	581.67	586.17	5,239	587,050	生活必需品
EXELON CORP	213.22	212.22	884	99,135	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	51	51	547	61,357	ヘルスケア
NVR INC	—	0.8	277	31,090	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	286.5	282.5	1,433	160,581	エネルギー
PEPSICO INC	327	326	3,808	426,796	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	102	99	1,147	128,534	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	40.5	40.5	365	41,001	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	145.5	142	2,086	233,813	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	22	19.5	104	11,702	金融
PENTAIR PLC	40.05	40.05	277	31,108	資本財・サービス
QUALCOMM INC	336.5	336	2,235	250,439	情報技術
INVESCO LTD	98.5	91.5	330	37,011	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	17	17	169	19,038	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	66	66	472	52,905	金融
RAYTHEON COMPANY	69	67	1,263	141,573	資本財・サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	18	20.5	166	18,690	一般消費財・サービス
RED HAT INC	42	40	497	55,796	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	18.1	18.1	649	72,733	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	56.5	53.5	344	38,551	資本財・サービス
PRICELINE GROUP INC/THE	11.4	11.2	1,942	217,666	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	94	90	683	76,591	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	21	21	241	27,081	素材
RESMED INC	32.5	32.5	277	31,044	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	33	31	301	33,808	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	28	28	159	17,826	資本財・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	196.78	—	—	—	その他
RITE AID CORP	230	—	—	—	生活必需品
RALPH LAUREN CORP	13	13	123	13,787	一般消費財・サービス
AUTONATION INC	17	17	94	10,545	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	29	36.63	483	54,169	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
REGIONS FINANCIAL CORP	288.35	274.35	454	50,937	金融
CHEVRON CORP	433.18	432.18	5,064	567,453	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	75	75	610	68,414	公益事業
TESLA INC	26.7	30.4	934	104,757	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	147	139	397	44,497	情報技術
ENDO INTERNATIONAL PLC	46	—	—	—	ヘルスケア
STANLEY BLACK & DECKER INC	34.72	34.72	581	65,206	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	34	34	295	33,056	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	48.85	49.05	1,626	182,287	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	71	71	305	34,200	不動産
TWITTER INC	130	144	299	33,545	情報技術
NAVIENT CORP	87	71	91	10,206	金融
SOUTHERN CO/THE	217.5	225.5	1,152	129,090	公益事業
SYSCO CORP	124	118	680	76,290	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	67.23	64.73	870	97,574	金融
SOUTHWESTERN ENERGY CO	110	—	—	—	エネルギー
SEI INVESTMENTS COMPANY	32	32	223	25,020	金融
STERICYCLE INC	19.5	19.5	127	14,265	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	—	57	215	24,187	素材
SCHLUMBERGER LTD	322.02	316.52	1,967	220,421	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	39	39	195	21,919	資本財・サービス
AT&T INC	1,414.91	1,402.91	5,117	573,451	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	38	34	200	22,431	資本財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18.3	19.3	760	85,196	素材
SEMPRA ENERGY	54	54	649	72,765	公益事業
TIFFANY & CO	28	28	259	29,036	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	70	71	275	30,827	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	230	227.5	2,204	246,960	情報技術
SALESFORCE.COM INC	147	154.5	1,599	179,228	情報技術
SIGNET JEWELERS LTD	17	13	68	7,629	一般消費財・サービス
WESTROCK CO	59.3	59.3	357	40,040	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	217.84	215.84	822	92,120	資本財・サービス
ANDEAVOR	28.5	34.5	362	40,648	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	189	186	2,286	256,222	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	190	190	280	31,402	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	123	119	730	81,870	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	182.5	174.5	2,061	231,034	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	159.5	157	1,868	209,413	資本財・サービス
UNUM GROUP	54	54	304	34,138	金融
SPRINT CORP	177.65	177.65	107	12,082	電気通信サービス
ANTERO RESOURCES CORP	34	51	95	10,720	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	34.94	31.94	323	36,257	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	50	45	197	22,150	金融
AMEREN CORPORATION	55	55	350	39,244	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	220.26	220.76	4,920	551,319	ヘルスケア
VERISIGN INC	22	22	252	28,284	情報技術
VALERO ENERGY CORP	107.92	103.42	861	96,576	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	13.9	13.1	292	32,747	一般消費財・サービス
FNF GROUP	57.38	57.38	230	25,852	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	20	20	214	24,084	ヘルスケア
ANTHEM INC	60.5	60.5	1,375	154,094	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	347	358.5	3,772	422,748	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	1,107.72	1,084.72	6,148	688,905	金融
FOOT LOCKER INC	32	32	136	15,271	一般消費財・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	103	100	826	92,575	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	167	187	529	59,339	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	31	31	215	24,092	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	17	17	287	32,190	一般消費財・サービス
WAL-MART STORES INC	351.5	346.5	3,380	378,779	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	46	46	535	60,057	ヘルスケア
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	195	221	71	7,973	エネルギー
WYNN RESORTS LTD	18	19.5	304	34,100	一般消費財・サービス
XEROX CORP	192.44	48.11	140	15,794	情報技術
WABTEC CORP	21	19	146	16,392	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	153.5	148.5	1,110	124,429	一般消費財・サービス
WATERS CORP	18	18	352	39,466	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	20	18	111	12,522	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	90.57	76.57	1,345	150,736	ヘルスケア
WHOLE FOODS MARKET INC	78	—	—	—	その他
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	212.5	211	1,517	170,037	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	30.83	29.83	474	53,168	金融
WESTERN DIGITAL CORP	64.5	67.5	546	61,263	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	73.8	71.3	493	55,332	公益事業
WESTAR ENERGY INC	32	32	180	20,183	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	117.5	117.5	619	69,384	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	429.5	423	4,647	520,705	情報技術
PPL CORP	154	154	563	63,173	公益事業
PULTEGROUP INC	74	67	226	25,382	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	61.5	59.5	696	78,010	素材
NORTHERN TRUST CORP	49	49	481	53,938	金融
NVIDIA CORP	124	136.5	2,681	300,420	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	113.93	110.93	1,550	173,680	金融
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	95.5	95.5	233	26,184	一般消費財・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	47	171	19,243	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	69	65	533	59,737	生活必需品
NETFLIX INC	98	99	1,862	208,713	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	90.5	89.5	1,723	193,168	ヘルスケア
TORCHMARK CORP	26.75	26.75	238	26,703	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	34	37	356	39,999	金融
TEXTRON INC	63.5	63.5	348	39,019	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	249.5	239.5	768	86,143	一般消費財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	103	103	322	36,123	一般消費財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	83.37	83.37	136	15,273	一般消費財・サービス
OGE ENERGY CORP	47	47	165	18,579	公益事業
OMNICOM GROUP	55	54	393	44,127	一般消費財・サービス
ORACLE CORP	702.83	707.33	3,431	384,551	情報技術
MASTERCARD INC - A	224.5	217.5	3,226	361,541	情報技術
ONEOK INC	49	88	443	49,725	エネルギー
CENTURYLINK INC	127.95	226.52	329	36,904	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	23	23	603	67,583	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	83	75	613	68,751	一般消費財・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	14	11.5	268	30,050	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	44	43.5	332	37,297	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	101	109	282	31,645	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	2,325.01	2,280.01	6,447	722,483	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	38	41	341	38,254	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	30	137	15,382	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	178	173.5	1,676	187,796	金融
ANALOG DEVICES INC	70	82.99	710	79,655	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	—	180	194	21,843	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	60	60	305	34,199	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	243.22	210.22	1,267	142,037	金融
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	14	—	—	—	素材
ANADARKO PETROLEUM CORP	127	127	608	68,134	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	44	41.5	437	48,979	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	40.5	40	498	55,890	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	45	45	135	15,177	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	25	25	55	6,199	ヘルスケア
AVERY DENNISON CORP	21	21	234	26,325	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	141.5	136	980	109,886	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	148.5	149	951	106,633	資本財・サービス
AON PLC	62	60	842	94,437	金融
AMGEN INC	174	168.5	2,902	325,177	ヘルスケア
CORE LABORATORIES N. V.	10	10	99	11,159	エネルギー
TAPESTRY INC	64	64	265	29,767	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	104.36	101.36	778	87,270	資本財・サービス
CELGENE CORP	179	178	1,835	205,671	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	41.2	38.8	831	93,193	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	245	245	1,296	145,249	情報技術
CIT GROUP INC	45	33	164	18,384	金融
CIMAREX ENERGY CO	22.5	22.5	257	28,798	エネルギー
CME GROUP INC	78	78	1,153	129,201	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	88.44	88.44	288	32,315	エネルギー
ECOLAB INC	61.5	59	796	89,247	素材
EQUIFAX INC	27.5	27.5	309	34,711	資本財・サービス
GAP INC/THE	58	58	188	21,121	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	306	300	2,210	247,641	ヘルスケア
ST JUDE MEDICAL INC	64.5	—	—	—	その他
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	43.98	41.48	371	41,579	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	68.5	68.5	246	27,623	生活必需品
STATE STREET CORP	91.93	87.43	827	92,753	金融
STAPLES INC	156	—	—	—	その他
SUNTRUST BANKS INC	115.98	111.98	686	76,915	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	274	277	1,341	150,285	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	114	113.5	739	82,893	ヘルスケア
B/E AEROSPACE INC	23	—	—	—	その他
CAMPBELL SOUP CO	46	41	200	22,506	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	31	31	183	20,570	素材
CARDINAL HEALTH INC	75.5	71.5	422	47,356	ヘルスケア
FEDEX CORP	58.5	58.5	1,321	148,095	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	114.04	109.54	996	111,656	金融
FMC CORP	32	31.5	293	32,899	素材
FLEX LTD	122	122	220	24,756	情報技術
CERNER CORP	70	67	467	52,378	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	18	18	278	31,173	素材
CITRIX SYSTEMS INC	36.5	35	304	34,119	情報技術
INTEL CORP	1,084	1,079	4,742	531,364	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	88	88	176	19,770	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	91	82.5	475	53,292	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	74	70.5	1,169	131,037	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	450	385	210	23,640	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC	33.5	33.5	762	85,388	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	44	44	208	23,339	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	8.7	25.2	993	111,336	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	31	29	295	33,163	情報技術

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
SNAP-ON INC	13	13	217	24,358	資本財・サービス	
CALPINE CORP	72	—	—	—	公益事業	
CARMAX INC	46	42.5	291	32,620	一般消費財・サービス	
COMERICA INC	40	40	333	37,420	金融	
INGREDION INC	16	16	223	25,054	生活必需品	
DUKE ENERGY CORP	158.28	160.78	1,430	160,337	公益事業	
TARGET CORP	129	119.5	737	82,589	一般消費財・サービス	
DOVER CORP	35	35	335	37,593	資本財・サービス	
WW GRAINGER INC	13	13	281	31,575	資本財・サービス	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	29	29	188	21,066	資本財・サービス	
CINTAS CORP	21	21	322	36,173	資本財・サービス	
CA INC	71.05	71.05	231	25,937	情報技術	
CONAGRA BRANDS INC	95	95	353	39,598	生活必需品	
CLOROX COMPANY	29.5	29.5	410	46,018	生活必需品	
ENTERGY CORP	42.5	42	361	40,543	公益事業	
MICROSOFT CORP	1,693.5	1,675.5	13,963	1,564,623	情報技術	
INCYTE CORP	38.5	40.5	388	43,546	ヘルスケア	
CVS HEALTH CORP	247.24	231.74	1,700	190,593	生活必需品	
MEDTRONIC PLC	316.38	314.38	2,581	289,242	ヘルスケア	
MICRON TECHNOLOGY INC	241	241	1,054	118,115	情報技術	
BLACKROCK INC	28.5	27.5	1,377	154,321	金融	
CENTERPOINT ENERGY INC	91	91	269	30,253	公益事業	
HASBRO INC	26	26	241	27,047	一般消費財・サービス	
KELLOGG CO	61	61	407	45,658	生活必需品	
KEYCORP	245	247	469	52,612	金融	
KANSAS CITY SOUTHERN	24	24	264	29,613	資本財・サービス	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	356.11	350.11	1,503	168,452	生活必需品	
KOHL'S CORP	44	39	186	20,844	一般消費財・サービス	
COOPER COS INC/THE	11	11	266	29,900	ヘルスケア	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	111	111	149	16,765	金融	
APACHE CORP	87.6	87.6	356	39,988	エネルギー	
CHUBB LTD	107.99	106.49	1,625	182,133	金融	
ARROW ELECTRONICS INC	20	20	160	17,999	情報技術	
ALLSTATE CORP	87	83.5	851	95,395	金融	
EBAY INC	250	234	804	90,143	情報技術	
PAYPAL HOLDINGS INC	249.5	261.5	1,915	214,630	情報技術	
EASTMAN CHEMICAL CO	35	32.5	297	33,288	素材	
XILINX INC	59.5	56	388	43,534	情報技術	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	143.1	135.1	849	95,157	ヘルスケア	
DISH NETWORK CORP-A	53	53	271	30,453	一般消費財・サービス	
YAHOO! INC	210	—	—	—	その他	
ZIONS BANCORPORATION	—	48	237	26,617	金融	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	51.5	51.5	638	71,514	生活必需品	
TOLL BROTHERS INC	38	38	190	21,327	一般消費財・サービス	
TRIMBLE INC	59	59	244	27,395	情報技術	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	56	—	—	—	その他	
LENNAR CORP-A	44	48	298	33,442	一般消費財・サービス	
LEAR CORP	17	15.5	277	31,105	一般消費財・サービス	
E*TRADE FINANCIAL CORP	65	65	310	34,799	金融	
PROGRESSIVE CORP	134	134	702	78,752	金融	
PRAXAIR INC	66	65	1,008	113,014	素材	
PACCAR INC	79.87	79.87	551	61,760	資本財・サービス	
PVH CORP	19	17.5	239	26,891	一般消費財・サービス	
BIOGEN INC	50.8	48.8	1,561	174,955	ヘルスケア	
IDEXX LABORATORIES INC	20	20	308	34,511	ヘルスケア	
STARBUCKS CORP	336	331	1,903	213,296	一般消費財・サービス	
PERRIGO CO PLC	34	30.5	267	29,978	ヘルスケア	
EVERSOURCE ENERGY	74.8	71.3	460	51,617	公益事業	
INTUIT INC	56	56	863	96,769	情報技術	
BORGWARNER INC	48	48	263	29,505	一般消費財・サービス	
BEST BUY CO INC	71	65	382	42,847	一般消費財・サービス	
BALL CORP	37.92	75.84	300	33,617	素材	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	310.47	310.47	805	90,275	ヘルスケア	
BED BATH & BEYOND INC	36	36	83	9,301	一般消費財・サービス	
XL GROUP LTD	68	61	241	27,025	金融	
ELECTRONIC ARTS INC	70.5	71	748	83,923	情報技術	
VULCAN MATERIALS CO	30.5	30.5	380	42,671	素材	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	56.5	56.5	812	91,005	ヘルスケア	
VF CORP	77.5	77.5	574	64,373	一般消費財・サービス	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	94.71	83.71	473	53,032	一般消費財・サービス	
VIACOM INC-CLASS B	81.71	81.71	232	26,020	一般消費財・サービス	
MOHAWK INDUSTRIES INC	15	14.7	410	45,971	一般消費財・サービス	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	52	63	103	11,555	情報技術	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	22	22	244	27,416	ヘルスケア	
CARNIVAL CORP	80.5	80.5	528	59,261	一般消費財・サービス	
COMCAST CORP-CLASS A	545.7	1,084.4	4,032	451,884	一般消費財・サービス	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	—	52	221	24,838	資本財・サービス	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	58	48	310	34,846	資本財・サービス	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	265	265	191	21,468	不動産	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	71,134.09	70,298.77	525,149	58,842,994	
	銘柄数 < 比率 >	584銘柄	600銘柄		< 62.0% >	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)					
IMPERIAL OIL LTD	72	67	264	23,074	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4.4	4.4	332	28,938	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	46.96	46.96	152	13,240	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	53.87	51.87	429	37,435	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	107	107	284	24,753	素材
INTACT FINANCIAL CORP	31.5	31.5	341	29,763	金融
BCE INC	34.3	34.3	211	18,430	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	43	43	458	39,943	素材
SUNCOR ENERGY INC	393.3	388.3	1,723	150,097	エネルギー
METRO INC	55	55	221	19,315	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	77	81	516	44,997	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	282	279	2,279	198,538	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	91.5	101.5	1,165	101,490	金融
TORONTO-DOMINION BANK	437	432	3,242	282,392	金融
GREAT-WEST LIFE CO INC	67	67	237	20,699	金融
ROYAL BANK OF CANADA	348.5	340.5	3,451	300,668	金融
TOURMALINE OIL CORP	47	54	123	10,728	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	25	28	124	10,862	エネルギー
TRANSCANADA CORP	189.5	205.5	1,272	110,866	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	94	116.29	507	44,202	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	454	454	133	11,665	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	273	273	492	42,919	素材
CAE INC	58	58	130	11,391	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	78.04	67.04	382	33,283	金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	202	194	486	42,378	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	39	39	96	8,424	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	14	16	126	11,012	素材
VERESEN INC	80	—	—	—	その他
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6.9	34.5	206	17,999	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	97	97	94	8,212	金融
LINAMAR CORP	11	11	74	6,522	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	54	54	92	8,071	エネルギー
HYDRO ONE LTD	40	72	163	14,229	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	51.6	51.6	351	30,642	生活必需品
EMERA INC	—	13	62	5,478	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	28	28	108	9,416	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	86	86	579	50,486	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	51	55	308	26,850	素材
KINROSS GOLD CORP	295	295	158	13,823	素材
BANK OF MONTREAL	152	153	1,521	132,516	金融
POWER CORP OF CANADA	87	81	265	23,161	金融
METHANEX CORP	22	22	147	12,834	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	—	19	253	22,076	情報技術
CAMECO CORP	92	92	108	9,415	エネルギー
TELUS CORP	54	54	259	22,599	電気通信サービス
POWER FINANCIAL CORP	56	57	202	17,634	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	134	134	390	33,998	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	17	16	260	22,703	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	208	248	94	8,208	素材
AGRIUM INC	31	33	460	40,133	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	255	261	1,116	97,274	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	5.4	6.4	446	38,893	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	93	84	595	51,902	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	11	11	120	10,479	生活必需品
BLACKBERRY LTD	119	119	163	14,199	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	142.5	142.5	725	63,163	金融
ENBRIDGE INC	220	381	1,743	151,821	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	205.5	207.5	1,103	96,113	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	469	460	1,246	108,538	金融
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	71	71	150	13,128	ヘルスケア
GOLDCORP INC	199.59	199.59	324	28,266	素材
ENCANA CORP	232	231	342	29,838	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	34	34	757	65,977	資本財・サービス
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	22	25	147	12,877	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	52	52	212	18,488	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	183.5	175.5	1,723	150,109	資本財・サービス
CGI GROUP INC - CLASS A	53	50	340	29,618	情報技術
HUSKY ENERGY INC	75.58	84.58	129	11,249	エネルギー
ONEX CORPORATION	20	20	183	16,005	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	95	101	293	25,529	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	39	39	118	10,309	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	34	42	232	20,288	資本財・サービス
ELDORADO GOLD CORP	172	—	—	—	素材
IGM FINANCIAL INC	23	19	84	7,385	金融
OPEN TEXT CORP	28	62	260	22,670	情報技術
CI FINANCIAL CORP	54	64	183	15,948	金融
SAPUTO INC	58	48	210	18,307	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	171	158	229	19,968	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	98	98	642	55,977	生活必需品
YAMANA GOLD INC	233	233	79	6,900	素材
YAMANA GOLD INC-RTS	14.56	—	—	—	その他
FORTIS INC	96	99	469	40,898	公益事業

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	133	133	121	10,588	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	196	240	283	24,708	エネルギー
DOLLARAMA INC	27	25	402	35,079	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	17	17	77	6,759	公益事業
ALTAGAS LTD	39	39	113	9,861	エネルギー
FIRST CAPITAL REALTY INC	26	38	79	6,897	不動産
KEYERA CORP	40	44	157	13,708	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	39	39	60	5,248	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	81	88	236	20,625	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	83	83	131	11,494	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,531 9,665.33 90銘柄	41,396	3,605,630	<3.8%>
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD	375	375	73	6,253	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD	617	617	199	16,913	金融
BHP BILLITON LIMITED	752	747	2,064	175,231	素材
SOUTH32 LTD	1,272	1,207	404	34,316	素材
LENDLEASE GROUP	121	—	—	—	不動産
ALUMINA LTD	699	569	131	11,155	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	182	176	548	46,529	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	397	355	164	13,919	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	118	118	134	11,456	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	620	626	1,851	157,154	金融
WESTPAC BANKING CORP	780.98	788.48	2,482	210,658	金融
SANTOS LTD	340	428	220	18,707	エネルギー
AUSNET SERVICES	410	410	76	6,472	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	689	684	1,967	167,012	金融
RIO TINTO LTD	97	100	717	60,851	素材
ORIGIN ENERGY LTD	414	414	374	31,763	エネルギー
AMCOR LIMITED	267	268	417	35,391	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	468	468	243	20,653	資本財・サービス
VOCUS GROUP LTD	100	—	—	—	電気通信サービス
OIL SEARCH LTD	329	329	232	19,741	エネルギー
SEEK LTD	75	75	140	11,903	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	171	171	265	22,494	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	176	176	423	35,938	素材
INCITEC PIVOT LTD	456	382	152	12,903	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	401	405.5	3,283	278,690	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	60	60	204	17,344	エネルギー
ORICA LTD	83	83	142	12,116	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	328	323	344	29,249	金融
CIMIC GROUP LTD	29	21	109	9,283	資本財・サービス
WOOLWORTHS LTD	300	300	808	68,642	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	137	137	106	9,022	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	205	205	99	8,438	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	106	96	120	10,200	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	145.54	102.54	57	4,916	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	986	986	334	28,368	電気通信サービス
AMP LTD	665	668	346	29,367	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	114	103	222	18,855	素材
MACQUARIE GROUP LTD	72.84	76.84	766	65,064	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	126	126	297	25,236	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	91	91	118	10,063	金融
CSL LTD	106	106	1,547	131,317	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	267.45	264.95	1,157	98,197	生活必需品
COCHLEAR LTD	14	14	257	21,826	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	—	134	186	15,842	素材
SUNCORP GROUP LTD	312	297	424	35,994	金融
BORAL LTD	227	277	210	17,843	素材
BORAL LTD-RTS	102.25	—	—	—	その他
ASX LTD	42	47	269	22,868	金融
COMPUTERSHARE LTD	139	104	172	14,598	情報技術
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	140	56	4,776	一般消費財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	549	549	396	33,687	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	95	95	212	18,020	ヘルスケア
TRANSURBAN GROUP	478	—	—	—	資本財・サービス
CHALLENGER LTD	122	139	194	16,515	金融
SYDNEY AIRPORT	251	—	—	—	資本財・サービス
TATTS GROUP LTD	369	305	132	11,234	一般消費財・サービス
AGL ENERGY LTD	152	155	392	33,321	公益事業
BRAMBLES LTD	373	373	382	32,447	資本財・サービス
APA GROUP	267	—	—	—	公益事業
DUET GROUP	500	—	—	—	その他
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	—	14	62	5,340	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	33	33	230	19,520	ヘルスケア
TPG TELECOM LTD	65	87	51	4,348	電気通信サービス
REA GROUP LTD	12	12	96	8,160	情報技術
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	14	14	65	5,571	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	18,405.06 16,427.31 63銘柄	27,144	2,303,720	<2.4%>

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港ドル	千円	
(香港)					
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	330	330	2, 211	31, 727	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	550	550	3, 187	45, 737	一般消費財・サービス
MTR CORP	345	345	1, 585	22, 748	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	350	340	4, 358	62, 548	不動産
SINO LAND CO	880	740	1, 025	14, 717	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	631. 69	631. 69	6, 149	88, 245	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	320	280	687	9, 864	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	125	125	941	13, 506	不動産
FIRST PACIFIC CO	—	560	322	4, 620	金融
CLP HOLDINGS LTD	425	380	3, 085	44, 278	公益事業
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	330	—	—	—	資本財・サービス
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	283. 86	279. 24	1, 442	20, 696	不動産
HANG LUNG GROUP LTD	—	210	567	8, 136	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1, 811. 42	1, 912. 56	2, 922	41, 936	公益事業
HANG SENG BANK LTD	179	179	3, 399	48, 778	金融
WHELOCK & CO LTD	250	200	1, 066	15, 297	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	1, 290	1, 330	1, 497	21, 490	不動産
WH GROUP LTD	1, 350	1, 945	1, 624	23, 305	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	273	273	6, 552	94, 021	金融
LI & FUNG LTD	1, 320	1, 320	456	6, 553	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	520	460	843	12, 106	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	65	58	676	9, 704	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	210	165	462	6, 641	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	465	355	491	7, 050	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	180	145	500	7, 178	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	290. 4	290. 4	974	13, 981	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	140	140	560	8, 036	不動産
SJM HOLDINGS LTD	470	470	297	4, 276	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	300	262	687	9, 869	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	641. 69	616. 69	4, 030	57, 831	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	150	150	1, 007	14, 454	公益事業
PCCW LTD	950	950	437	6, 284	電気通信サービス
AIA GROUP LTD	2, 830	2, 812	18, 545	266, 122	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	—	280	1, 334	19, 145	不動産
SANDS CHINA LTD	572	572	2, 196	31, 519	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	300	300	541	7, 774	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	315	315	1, 417	20, 341	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	200	200	403	5, 783	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	875	875	3, 403	48, 843	金融
WYNN MACAU LTD	380	380	891	12, 787	一般消費財・サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	570	—	—	—	電気通信サービス
香港ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	21, 468. 06 38 銘柄	21, 726. 58 39 銘柄	82, 783 < 1. 3% >	
(シンガポール)					
UNITED OVERSEAS BANK LTD	300	313	814	67, 752	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	415	415	1, 023	85, 135	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	124. 7	124. 7	131	10, 944	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	345	345	265	22, 128	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	132	132	116	9, 652	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	112	112	134	11, 208	不動産
CAPITALAND LTD	590	590	207	17, 276	不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	—	420	64	5, 345	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	410	410	111	9, 311	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30	23	91	7, 645	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	742	742	912	75, 924	金融
GENTING SINGAPORE PLC	1, 530	1, 530	208	17, 310	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1, 886. 5	1, 886. 5	705	58, 694	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	350	350	113	9, 462	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	290	227	69	5, 778	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	2, 194	1, 644	62	5, 197	生活必需品
SATS LTD	—	160	83	6, 921	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	190	190	141	11, 807	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	468	468	95	7, 942	資本財・サービス
STARHUB LTD	160	160	46	3, 833	電気通信サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	560	372	117	9, 779	生活必需品
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	690	630	210	17, 504	不動産
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11, 519. 2 20 銘柄	11, 244. 2 22 銘柄	5, 728 < 0. 5% >	
(ニュージーランド)					
MERIDIAN ENERGY LTD	260	260	74	5, 681	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	526. 89	526. 89	189	14, 504	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	234	234	152	11, 698	資本財・サービス
CONTACT ENERGY LTD	130	130	71	5, 502	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	201	201	137	10, 557	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	53	88	91	7, 017	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1, 404. 89 6 銘柄	1, 439. 89 6 銘柄	716 < 0. 1% >	
(イギリス)					
MERLIN ENTERTAINMENT	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	一般消費財・サービス
	163	163	58	8, 720	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
TUI AG-DI	117.47	102.47	137	20,734	一般消費財・サービス
BP PLC	4,363	4,607	2,278	342,476	エネルギー
UNILEVER PLC	301.1	301.1	1,269	190,834	生活必需品
BARCLAYS PLC	3,975	3,955	768	115,492	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	434	384	330	49,702	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	381	381	119	17,892	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	23	21.5	148	22,349	素材
PRUDENTIAL PLC	602	602	1,143	171,947	金融
INMARSAT PLC	103	103	49	7,492	電気通信サービス
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	792.91	838.91	236	35,513	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	45.64	45.64	139	20,987	素材
BAE SYSTEMS PLC	761	748	406	61,171	資本財・サービス
AVIVA PLC	939.66	960.66	488	73,507	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,150.02	1,145.02	1,497	225,061	ヘルスケア
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	—	100	249	37,552	情報技術
WORLDPAY GROUP PLC	427	471	196	29,596	情報技術
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	80	80	43	6,494	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	252	224	75	11,364	情報技術
DCC PLC	20	20	144	21,767	資本財・サービス
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITLED	19,964	—	—	—	その他
CONVATEC GROUP PLC	—	330	63	9,480	ヘルスケア
ROLLS-ROYCE HOLDINGS- ENTITLED	—	17,664	1	265	その他
ROYAL MAIL PLC	224	224	97	14,708	資本財・サービス
RELX PLC	256.46	248.46	434	65,364	資本財・サービス
DIAGEO PLC	594	586	1,519	228,470	生活必需品
RIO TINTO PLC	291.5	287	1,009	151,783	素材
STANDARD CHARTERED PLC	783	779	583	87,713	金融
TESCO PLC	1,911	1,911	378	56,881	生活必需品
FRESNILLO PLC	50	50	65	9,793	素材
SMITH & NEPHEW PLC	215	203	266	40,007	ヘルスケア
GLENCORE PLC	2,909.25	2,851.25	976	146,805	素材
WOOD GROUP (JOHN) PLC	—	162	115	17,364	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	57	65	103	15,614	金融
SMITHS GROUP PLC	93.33	93.33	139	21,017	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	61	61	42	6,405	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	339.83	310.83	113	17,017	金融
DIXONS CARPHONE PLC	248	248	40	6,136	一般消費財・サービス
PEARSON PLC	188.63	188.63	133	20,076	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	381.25	381.25	89	13,503	生活必需品
NEXT PLC	33	33	148	22,338	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	739	739	144	21,796	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	43.11	43.11	156	23,550	一般消費財・サービス
IMI PLC	58.5	66.5	84	12,746	資本財・サービス
BUNZL PLC	77.55	77.55	163	24,575	資本財・サービス
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	206	—	—	—	その他
GKN PLC	406	406	126	18,999	一般消費財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	6,261.83	6,236.83	1,404	211,190	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	29.93	29.93	128	19,329	素材
KINGFISHER PLC	519.11	519.11	174	26,259	一般消費財・サービス
WPP PLC	298	298	390	58,685	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	159.27	159.27	129	19,393	公益事業
SEVERN TRENT PLC	57.33	57.33	122	18,348	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	149	157	1,023	153,836	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	119	119	144	21,681	金融
SCHRODERS PLC	32	28	96	14,542	金融
TATE & LYLE PLC	101	114	76	11,447	生活必需品
SSE PLC	238	239	325	48,935	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	48	54	108	16,268	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	227	227	138	20,782	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	298	297.5	1,457	219,143	ヘルスケア
FERGUSON PLC	59.65	59.65	319	48,019	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,436	1,381	370	55,721	金融
3I GROUP PLC	229.91	229.91	210	31,641	金融
SKY PLC	248	245	229	34,436	一般消費財・サービス
ASHTED GROUP PLC	122	114	219	33,058	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	261.14	256.14	199	29,995	情報技術
NATIONAL GRID PLC	888.28	802.34	706	106,141	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	15,039.65	16,729.65	1,122	168,754	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	242.6	242.6	147	22,155	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	226.5	226.5	689	103,715	生活必需品
CENTRICA PLC	1,283.6	1,283.6	183	27,555	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	30	30	115	17,327	一般消費財・サービス
PROVIDENT FINANCIAL PLC	36.5	36.5	32	4,856	金融
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	435.6	536.6	2,576	387,363	生活必需品
NEX GROUP PLC	120	—	—	—	金融
BHP BILLITON PLC	501.77	495.77	669	100,614	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	85	81	243	36,676	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	4,633	4,695	3,489	524,550	金融
SHIRE PLC	210.74	209.74	779	117,182	ヘルスケア
OLD MUTUAL PLC	1,170.25	1,170.25	234	35,272	金融
ANGLO AMERICAN PLC	334.83	306.83	422	63,469	素材
MONDI PLC	83	83	146	22,072	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	509	509	111	16,711	生活必需品

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円			
CARNIVAL PLC	45.11	45.11	219	32,950	一般消費財・サービス		
EASYJET PLC	35	35	49	7,403	資本財・サービス		
COMPASS GROUP PLC	388.41	373.89	566	85,153	一般消費財・サービス		
PERSIMMON PLC	75.5	70.5	182	27,460	一般消費財・サービス		
BT GROUP PLC	2,000	1,966	502	75,483	電気通信サービス		
COCA-COLA HBC AG-DI	44	44	105	15,788	生活必需品		
WILLIAM HILL PLC	192	—	—	—	一般消費財・サービス		
BURBERRY GROUP PLC	104.89	104.89	180	27,184	一般消費財・サービス		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	44.77	42.86	187	28,201	一般消費財・サービス		
CAPITA PLC	150.9	150.9	74	11,224	資本財・サービス		
TRAVIS PERKINS PLC	59	59	93	14,066	資本財・サービス		
INTERTEK GROUP PLC	38	38	198	29,848	資本財・サービス		
ITV PLC	868	868	137	20,669	一般消費財・サービス		
PETROFAC LTD	56	—	—	—	エネルギー		
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	75.49	71.99	273	41,178	金融		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,000	1,043	2,467	370,975	エネルギー		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	881.18	872.18	2,106	316,642	エネルギー		
MEGGITT PLC	177	177	86	12,963	資本財・サービス		
G4S PLC	346	346	88	13,341	資本財・サービス		
COBHAM PLC	386	556	71	10,765	資本財・サービス		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	33	33	33	5,099	ヘルスケア		
ADMIRAL GROUP PLC	52	45	86	12,995	金融		
INVESTEC PLC	145	160	82	12,447	金融		
ANTOFAGASTA PLC	86	98	90	13,568	素材		
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	454.63	633.57	270	40,593	金融		
EXPERIAN PLC	230.54	220.54	343	51,653	資本財・サービス		
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	89,754.12 106銘柄	89,576.69 105銘柄	44,221 <7.0% >	6,647,873		
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円			
AZRIELI GROUP LTD	10	10	186	5,970	不動産		
FRUTAROM	—	9	270	8,660	素材		
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	564	483	247	7,913	電気通信サービス		
ISRAEL CHEMICALS LTD	140	140	196	6,268	素材		
ELBIT SYSTEMS LTD	—	6	296	9,469	資本財・サービス		
BANK HAPOALIM BM	265	245	585	18,725	金融		
BANK LEUMI LE-ISRAEL	376	334	654	20,935	金融		
NICE LTD	17	14	427	13,664	情報技術		
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	—	30	189	6,063	金融		
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,372 6銘柄	1,271 9銘柄	3,054 <0.1% >	97,670		
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円			
DUFREY AG-REG	10.5	8.5	120	13,719	一般消費財・サービス		
UBS GROUP AG-REG	860	855	1,454	165,549	金融		
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	2	129	14,729	素材		
ADECCO GROUP AG-REG	40	39	289	32,917	資本財・サービス		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	165	164.8	4,083	464,852	ヘルスケア		
PARGESA HOLDING SA-BR	8	9.5	79	9,051	金融		
SIKA AG-BR	0.54	0.5	378	43,113	素材		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.02	135	15,418	生活必需品		
ABB LTD-REG	439	464	1,165	132,676	資本財・サービス		
ARYZTA AG	21	—	—	—	生活必需品		
SWISS RE AG	78	75.5	701	79,796	金融		
NESTLE SA-REG	727	725.5	6,163	701,548	生活必需品		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	4.2	4.2	281	32,031	金融		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	9.7	215	24,567	資本財・サービス		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	435.2	561.2	917	104,382	金融		
JULIUS BAER GROUP LTD	52	52	296	33,798	金融		
SGS SA-REG	1.3	1.3	312	35,544	資本財・サービス		
SCHINDLER HOLDING AG-REG	5	5	108	12,367	資本財・サービス		
VIFOR PHARMA AG	0.9	12	148	16,924	ヘルスケア		
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7.5	7.4	264	30,164	一般消費財・サービス		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	35.12	35.22	1,041	118,508	金融		
BALOISE HOLDING AG - REG	12	12	181	20,639	金融		
NOVARTIS AG-REG	522	517.5	4,331	493,051	ヘルスケア		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.5	0.5	90	10,267	生活必需品		
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	123.5	122	1,027	116,930	一般消費財・サービス		
SWISSCOM AG-REG	5.9	6.2	319	36,381	電気通信サービス		
GEBERIT AG-REG	9	8.5	362	41,266	資本財・サービス		
GIVAUDAN-REG	2.2	2.2	487	55,469	素材		
ACTELION LTD-REG	22.5	—	—	—	その他		
STRAUMANN HOLDING AG-REG	—	2.2	160	18,218	ヘルスケア		
SYNGENTA AG-REG	21.62	—	—	—	素材		
SONOVA HOLDING AG-REG	13	12	185	21,076	ヘルスケア		
LONZA GROUP AG-REG	13	17.5	445	50,716	ヘルスケア		
SWATCH GROUP AG/THE-REG	11	13	90	10,254	一般消費財・サービス		
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	108.4	105.4	569	64,787	素材		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	8	7.7	253	28,906	金融		
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	12.5	12.5	213	24,345	資本財・サービス		
SWISS PRIME SITE-REG	16	16.5	139	15,917	不動産		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.23	0.23	131	14,949	生活必需品		
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,803.63 38銘柄	3,888.27 36銘柄	27,276 <3.3% >	3,104,842		

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	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	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)						
NOVO NORDISK A/S-B		450	434	13,974	249,310	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S		163.5	175.5	4,171	74,421	金融
ISS A/S		39	39	909	16,218	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A		0.95	0.85	890	15,891	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S		—	17	526	9,389	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		52	50	1,959	34,957	資本財・サービス
TDC A/S		193	193	726	12,959	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B		24.5	24.5	1,795	32,037	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES		55	52	1,730	30,873	素材
COLOPLAST-B		28	28	1,374	24,526	ヘルスケア
DSV A/S		46	45	2,151	38,373	資本財・サービス
WILLIAM DEMANT HOLDING		33.75	26.75	462	8,251	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		1.6	1.5	1,635	29,168	資本財・サービス
TRYG A/S		—	25	387	6,913	金融
PANDORA A/S		26.5	25.5	1,550	27,659	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		23.5	23.5	1,297	23,142	素材
GENMAB A/S		13	13	1,560	27,830	ヘルスケア
ORSTED A/S		—	44.5	1,582	28,238	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,150.3 15銘柄	1,218.6 18銘柄	38,686	690,163	
(ノルウェー)						
NORSK HYDRO ASA		334	306	1,811	24,600	素材
DNB ASA		225.5	225.5	3,418	46,424	金融
ORKLA ASA		190.5	190.5	1,581	21,472	生活必需品
TELENOR ASA		178	180	3,312	44,976	電気通信サービス
STATOIL ASA		261.73	260.73	4,341	58,952	エネルギー
SCHIBSTED ASA-CL A		15	15	338	4,595	一般消費財・サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		41.6	41.6	1,550	21,049	素材
MARINE HARVEST		87	99	1,402	19,050	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		48.5	48.5	738	10,030	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS		18	18	377	5,121	一般消費財・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,399.83 10銘柄	1,384.83 10銘柄	18,871	256,273	
(スウェーデン)						
ICA GRUPPEN AB		19	19	573	7,667	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS		722.3	710.3	3,778	50,560	情報技術
VOLVO AB-B SHS		345	366	5,793	77,520	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		15	15	804	10,757	電気通信サービス
SKF AB-B SHARES		86.5	87.5	1,689	22,607	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B		54.5	54.5	1,491	19,951	一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB		706.5	708.5	6,950	92,996	金融
SWEDISH MATCH AB		45.5	41.5	1,306	17,479	生活必需品
TELE2 AB-B SHS		89.5	89.5	959	12,837	電気通信サービス
GETINGE AB-B SHS		47	56	854	11,434	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		341.5	350.5	3,462	46,334	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		352	352	4,026	53,879	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		213	209	4,165	55,732	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		217	226	4,402	58,905	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		141	—	—	—	素材
SKANSKA AB-B SHS		82.5	76.5	1,394	18,659	資本財・サービス
SANDVIK AB		244.5	262.5	3,816	51,068	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		108	105.5	4,156	55,616	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		157	157	5,725	76,611	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS		92	74	1,079	14,445	資本財・サービス
TELIA CO AB		600	600	2,202	29,462	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB		70	70	1,399	18,722	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		91	91	2,973	39,790	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		233	233	3,991	53,403	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS		—	9	558	7,472	金融
LUNDIN PETROLEUM AB		64	42	816	10,930	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B		—	141	3,419	45,749	生活必需品
BOLIDEN AB		60	65	1,746	23,368	素材
HUSQVARNA AB-B SHS		125.5	97.5	748	10,012	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B		53	53	1,424	19,054	金融
HEXAGON AB-B SHS		62	62	2,548	34,094	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		35	40	816	10,928	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,472.8 30銘柄	5,464.3 31銘柄	79,077	1,058,055	
ユーロ (アイルランド)						
BANK OF IRELAND GROUP PLC		6,618	220.6	145	19,278	金融
KERRY GROUP PLC-A		38.5	38.5	337	44,796	生活必需品
CRH PLC		194	194	576	76,599	素材
PADDY POWER BETFAIR PLC		19	19	181	24,153	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,869.5 4銘柄	472.1 4銘柄	1,241	164,828	
ユーロ (オランダ)						
QIAGEN N. V.		54.5	52.48	140	18,710	ヘルスケア

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	218.76	214.76	696	92,512	ヘルスケア
NN GROUP NV	76	75	269	35,769	金融
UNILEVER NV-CVA	383.5	379.5	1,854	246,261	生活必需品
HEINEKEN NV	53	61	521	69,258	生活必需品
RELX NV	234.19	227.19	441	58,686	資本財・サービス
AEGON NV	407.44	407.44	214	28,457	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	298.83	294.83	514	68,367	生活必需品
AKZO NOBEL	58	58	438	58,288	素材
KONINKLIJKE DSM NV	44	43.5	341	45,374	素材
WOLTERS KLUWER	69	69	299	39,762	資本財・サービス
BOSKALIS WESTMINSTER	21	21	64	8,625	資本財・サービス
ING GROEP NV	918.5	903.5	1,386	184,190	金融
KONINKLIJKE KPN NV	782.5	782.5	238	31,717	電気通信サービス
ASML HOLDING NV	86.8	87.5	1,294	171,930	情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA	54	88	218	28,955	金融
VOPAK	16	16	56	7,456	エネルギー
RANDSTAD HOLDING NV	30	28.5	146	19,394	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	23	26	209	27,869	生活必需品
GEMALTO	20	20	63	8,414	情報技術
ALTICE NV - A	89	115	80	10,737	一般消費財・サービス
ALTICE NV - B	29	21	14	1,966	一般消費財・サービス
AIRBUS SE	136	135.5	1,182	157,084	資本財・サービス
EXOR NV	—	25	128	17,099	金融
CNH INDUSTRIAL NV	243	243	263	35,016	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	193.5	250.5	362	48,106	一般消費財・サービス
FERRARI NV	28.35	28.35	263	34,959	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,567.87 26銘柄	4,674.05 27銘柄	11,708	1,554,973 <1.6%>
ユーロ (ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UCB SA	27.5	30	193	25,702	ヘルスケア
KBC GROEP NV	58	58	399	52,996	金融
COLRUYT SA	20	16	70	9,381	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	17	18.5	166	22,061	金融
SOLVAY SA	17	17	200	26,562	素材
UMICORE	22.5	45	175	23,287	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	179	178.1	1,742	231,449	生活必需品
AGEAS	47.9	41.4	170	22,587	金融
PROXIMUS	35	35	99	13,280	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	12	12	69	9,280	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	435.9 10銘柄	451 10銘柄	3,287	436,588 <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	65	8,708	一般消費財・サービス
ARCELORMITTAL	423	156	400	53,256	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	—	2.7	136	18,173	ヘルスケア
SES	83.5	83.5	112	14,876	一般消費財・サービス
TENARIS SA	105.5	112.5	136	18,123	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	622 4銘柄	364.7 5銘柄	851	113,138 <0.1%>
ユーロ (フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA	16	16	55	7,345	一般消費財・サービス
SFR GROUP SA	23	—	—	—	その他
TOTAL SA	521.5	547.5	2,611	346,879	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	42	39.5	483	64,158	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	90.48	99.52	1,048	139,309	素材
KERING	18	17.9	672	89,362	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	132	132	956	127,081	資本財・サービス
BOUYGUES SA	46.5	50	215	28,683	資本財・サービス
BNP PARIBAS	249	260.5	1,674	222,424	金融
PEUGEOT SA	112.5	123.5	213	28,367	一般消費財・サービス
NATIXIS	229.5	229.5	153	20,378	金融
THALES SA	25.5	25.5	214	28,447	資本財・サービス
DANONE	138	138.5	989	131,389	生活必需品
CARREFOUR SA	129	128	227	30,225	生活必需品
SUEZ	74.75	88.75	138	18,399	公益事業
VIVENDI	237.41	237.41	539	71,605	一般消費財・サービス
L'OREAL	59.5	58.5	1,093	145,248	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	115	115	557	74,097	資本財・サービス
LEGRAND SA	63.67	63.17	395	52,527	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	13	13	66	8,838	生活必需品
PERNOD RICARD SA	49.17	49.17	642	85,285	生活必需品
SOCIETE BIC SA	7	7	66	8,854	資本財・サービス
EURAZEO SA	10.75	11.16	81	10,801	金融
REXEL SA	70.5	70.5	109	14,540	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA	180	180	772	102,543	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	65.5	65.6	1,607	213,539	一般消費財・サービス
ACCOR SA	40	44	185	24,642	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	39	37.5	365	48,508	情報技術
VALEO SA	56.5	56.5	343	45,585	一般消費財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
PUBLICIS GROUPE	46	47.5	266	35,327	一般消費財・サービス	
BUREAU VERITAS SA	60.5	60.5	134	17,881	資本財・サービス	
EIFFAGE	13	17	157	20,882	資本財・サービス	
SODEXO SA	23	21.5	235	31,323	一般消費財・サービス	
IPSEN	—	9	93	12,371	ヘルスクエア	
INGENICO GROUP	12	13.5	117	15,542	情報技術	
ZODIAC AEROSPACE	48	48	118	15,733	資本財・サービス	
SEB SA	—	5	78	10,422	一般消費財・サービス	
ESSILOR INTERNATIONAL	49	48.5	517	68,728	ヘルスクエア	
DASSAULT AVIATION SA	—	0.6	77	10,342	資本財・サービス	
AXA SA	455	455	1,161	154,213	金融	
CHRISTIAN DIOR SE	13	—	—	—	一般消費財・サービス	
LAGARDERE SCA	26.5	26.5	72	9,601	一般消費財・サービス	
TECHNIP SA	25.5	—	—	—	その他	
EDENRED	47.5	53.5	129	17,233	資本財・サービス	
RENAULT SA	46	41	351	46,714	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL	6.2	7.3	318	42,348	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU	5.5	5.5	60	8,075	生活必需品	
ATOS SE	21.5	21.5	265	35,278	情報技術	
DASSAULT SYSTEMES SA	30.5	30.5	271	36,087	情報技術	
WENDEL	6	6.8	95	12,679	金融	
ORANGE	469	468	676	89,876	電気通信サービス	
ALSTOM	36.5	36.5	126	16,782	資本財・サービス	
CNP ASSURANCES	37.5	37.5	70	9,427	金融	
SANOFI	273.75	263.25	2,026	269,139	ヘルスクエア	
VINCI SA	118.5	116.5	1,012	134,454	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	105.5	114.5	243	32,397	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA	257	270	382	50,847	金融	
ENGIE	341.73	428.73	634	84,270	公益事業	
IMERYS SA	9	9	69	9,191	素材	
EDF	55.5	127.5	144	19,134	公益事業	
SAFRAN SA	74	74	669	88,874	資本財・サービス	
ILIAD SA	6	6	118	15,706	電気通信サービス	
ARKEMA	15.5	15.5	158	21,089	素材	
ADP	7.5	7.5	119	15,817	資本財・サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	40.5	40.5	76	10,192	一般消費財・サービス	
SCOR SE	41	41.5	143	19,023	金融	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	104.5	104.5	115	15,287	資本財・サービス	
BOLLORE	190	190	84	11,229	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,972.41 65銘柄	6,174.86 65銘柄	27,878	3,702,606 <3.9%>	
ユーロ (ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	195.5	193.5	2,090	277,674	ヘルスクエア	
EVONIK INDUSTRIES AG	38	38	118	15,687	素材	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	321.5	486.5	781	103,831	金融	
COMMERZBANK AG	246.85	246.85	299	39,783	金融	
VOLKSWAGEN AG	8	8	137	18,264	一般消費財・サービス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	43.5	43	759	100,910	一般消費財・サービス	
MAN SE	8.5	8.5	80	10,690	資本財・サービス	
SIEMENS AG-REG	179	179.5	2,055	272,961	資本財・サービス	
E.ON SE	465	517	509	67,625	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	77.5	78	660	87,773	一般消費財・サービス	
GEA GROUP AG	42	42	168	22,440	資本財・サービス	
OSRAM LICHT AG	21.6	23.6	165	21,971	資本財・サービス	
CONTINENTAL AG	25.5	25.5	560	74,387	一般消費財・サービス	
BASF SE	216.5	213.5	1,999	265,487	素材	
LINDE AG	44	—	—	—	素材	
K+S AG-REG	44	44	86	11,523	素材	
ALLIANZ SE-REG	106.8	106.5	2,131	283,026	金融	
THYSSENKRUPP AG	85	102	236	31,394	素材	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	42	42	477	63,449	生活必需品	
RWE AG	118	119	233	31,024	公益事業	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50.5	56.5	162	21,528	資本財・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	9	9	75	10,040	資本財・サービス	
BRENTAG AG	36.5	36.5	190	25,309	資本財・サービス	
FRESENIUS SE & CO KGAA	97	96.5	584	77,640	ヘルスクエア	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	27	30	165	21,953	情報技術	
HOCHTIEF AG	5	5	73	9,734	資本財・サービス	
SAP SE	231.42	229.92	2,192	291,127	情報技術	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	38.7	36.2	695	92,404	金融	
SCHAEFFLER AG	38	38	55	7,355	一般消費財・サービス	
ZALANDO SE	19	26	111	14,848	一般消費財・サービス	
HEIDELBERGCEMENT AG	33	35	312	41,458	素材	
KION GROUP AG	—	16.5	114	15,142	資本財・サービス	
COVESTRO AG	16	26	226	30,038	素材	
INNOGY SE	34	34	133	17,746	公益事業	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	37	35.5	251	33,427	一般消費財・サービス	
METRO AG	—	41	66	8,883	生活必需品	
LINDE AG - TENDER	—	43	844	112,103	素材	
BEIERSDORF AG	23	23	226	30,051	生活必需品	

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
FUCHS PETROLUB SE -PREF	15	15	65	8,725	素材	
MERCK KGAA	31	31	280	37,251	ヘルスケア	
ADIDAS AG	44.2	44.1	783	104,048	一般消費財・サービス	
HENKEL AG & CO KGAA	24	24	245	32,655	生活必需品	
CECONOMY AG	41	—	—	—	一般消費財・サービス	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	754	758	1,122	149,092	電気通信サービス	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	50.5	50.5	418	55,586	ヘルスケア	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	225	225	1,577	209,564	一般消費財・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	270	262	608	80,796	情報技術	
HANNOVER RUECK SE	14	14	155	20,629	金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	231	226	900	119,595	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	—	44.5	420	55,808	金融	
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	46	—	—	—	その他	
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	50.5	55.5	150	19,960	一般消費財・サービス	
LANXESS AG	22	22	139	18,477	素材	
AXEL SPRINGER SE	10	12	79	10,505	一般消費財・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	82	84	308	41,004	不動産	
SYMRISE AG	30	30	211	28,057	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	165	165	65	8,721	電気通信サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	12	12	87	11,618	一般消費財・サービス	
HUGO BOSS AG -ORD	16.5	14.5	99	13,260	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	109	109	425	56,493	不動産	
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,266.57 56銘柄	5,532.67 57銘柄	28,179	3,742,556 <3.9%>	
ユーロ (ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円		
JERONIMO MARTINS	60	60	100	13,295	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	495	495	143	19,117	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	103.5	116.5	186	24,763	エネルギー	
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	658.5 3銘柄	671.5 3銘柄	430	57,176 <0.1%>	
ユーロ (スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELEFONICA SA	1,046.27	1,046.27	906	120,362	電気通信サービス	
ENDESA SA	76.5	76.5	145	19,293	公益事業	
BANCO POPULAR ESPANOL	754.73	—	—	—	金融	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,534.12	1,555.12	1,131	150,337	金融	
IBERDROLA SA	1,271.34	1,357.34	906	120,329	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	1,319.09	1,229.09	210	27,929	金融	
BANKINTER SA	151	151	122	16,209	金融	
REPSOL SA	257	287	442	58,775	エネルギー	
GRIFOLS SA	67	67	164	21,849	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	3,438.5	3,782.5	2,157	286,542	金融	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	149	158	294	39,072	資本財・サービス	
AMADEUS IT GROUP SA	100	101	616	81,864	情報技術	
GAS NATURAL SDG SA	84.5	84.5	159	21,154	公益事業	
MAPFRE SA	214.5	254.5	72	9,653	金融	
CAIXABANK S. A	748	816	330	43,847	金融	
CAIXABANK S. A-RTS	748	—	—	—	その他	
ZARDOYA OTIS SA	45.5	—	—	—	資本財・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	180	152	105	14,007	資本財・サービス	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	44.76	53.76	176	23,429	資本財・サービス	
AENA SME SA	16	16	271	35,996	資本財・サービス	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	253	253	753	100,046	一般消費財・サービス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	—	56	59	7,853	資本財・サービス	
ENAGAS SA	54	54	132	17,531	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	100	100	189	25,147	公益事業	
FERROVIAL SA	117	117	216	28,746	資本財・サービス	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	157	157	62	8,236	生活必需品	
BANKIA SA	1,084.22	241.05	97	12,946	金融	
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	14,011.03 26銘柄	12,165.63 24銘柄	9,721	1,291,165 <1.4%>	
ユーロ (イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	217.5	217.5	41	5,543	金融	
PRYSMIAN SPA	48	48	133	17,747	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	278.43	290.43	441	58,668	金融	
SAIPEM SPA	1,343	134.3	46	6,207	エネルギー	
MEDIOBANCA SPA	146.15	130.15	123	16,438	金融	
UNICREDIT SPA	1,235.69	473.06	806	107,057	金融	
TELECOM ITALIA SPA	2,582.82	2,662.82	186	24,773	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	1,349.5	1,349.5	77	10,278	電気通信サービス	
INTESA SANPAOLO-RSP	210	210	55	7,418	金融	
INTESA SANPAOLO	2,985.97	3,143.97	886	117,749	金融	
ATLANTIA SPA	99.07	106.07	293	39,021	資本財・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	118	118	72	9,630	金融	
RECORDATI SPA	—	26	97	12,990	ヘルスケア	
ENI SPA	598	591	813	108,003	エネルギー	
LEONARDO SPA	95.25	95.25	95	12,688	資本財・サービス	
ENEL SPA	1,778.34	1,896.34	1,038	137,889	公益事業	
SNAM SPA	582	532	225	29,887	エネルギー	

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		
LUXOTTICA GROUP SPA	37	38.5	184	24,563	一般消費財・サービス 公益事業 金融	
TERNA SPA	354	324	167	22,311		
EXOR SPA	25	—	—	—		
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	14,083.72 19銘柄	12,386.89 19銘柄	5,789	768,866 <0.8%>	
ユーロ (フィンランド)	株数	株数	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ	124	124	318	42,274	素材	
NOKIA OYJ	1,358.5	1,389.5	584	77,691	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP	32	33.5	185	24,648	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS	131	131	171	22,721	素材	
METSO OYJ	30	24	71	9,492	資本財・サービス	
ELISA OYJ	35.5	32.5	110	14,645	電気通信サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	103	103.5	461	61,278	金融	
FORTUM OYJ	104.5	104.5	183	24,329	公益事業	
KONE OYJ-B	78.5	78.5	341	45,361	資本財・サービス	
NOKIAN RENKAAT OYJ	30	26.5	96	12,835	一般消費財・サービス	
NESTE OYJ	29.5	29.5	149	19,824	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	20.5	24.5	79	10,516	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,077 12銘柄	2,101.5 12銘柄	2,752	365,619 <0.4%>	
ユーロ (オーストリア)	株数	株数	千ユーロ	千円		
OMV AG	35.5	35.5	185	24,573	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	66.5	66.5	242	32,267	金融	
VOESTALPINE AG	28.5	28.5	139	18,554	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	24	34	102	13,636	金融	
ANDRITZ AG	16	16	74	9,852	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	170.5 5銘柄	180.5 5銘柄	744	98,884 <0.1%>	
ユーロ (その他)	株数	株数	千ユーロ	千円		
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	52	52	168	22,355	生活必需品	
STMICROELECTRONICS NV	153	146	275	36,540	情報技術	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	205 2銘柄	198 2銘柄	443	58,896 <0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	54,940 232銘柄	45,373.4 233銘柄	93,029	12,355,299 <13.0%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	291,354.98 1,238銘柄	278,979.17 1,256銘柄	—	90,681,988 <95.5%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	株数	株数	期末	
			評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3.197	3.197	581	65,211
SIMON PROPERTY GROUP INC	7.187	7.137	1,132	126,936
BOSTON PROPERTIES INC	3.6	3.55	443	49,742
GGP INC	13.6	14.4	336	37,756
VORNADO REALTY TRUST	3.827	3.827	294	32,988
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	2.75	466	52,309
EQUITY RESIDENTIAL	8.5	8.5	567	63,564
EQUINIX INC	1.608	1.808	846	94,875
AMERICAN TOWER CORP	9.75	9.75	1,426	159,830
HOST HOTELS & RESORTS INC	17.293	17.293	340	38,114
KIMCO REALTY CORP	10	10	184	20,695
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	12	147	16,538
VENTAS INC	7.9	8.3	531	59,586
WEYERHAEUSER CO	17.614	16.964	600	67,231
AGNC INVESTMENT CORP	7.8	9	180	20,239
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6.9	6.9	125	14,102
CROWN CASTLE INTL CORP	7.75	9.25	1,043	116,975
IRON MOUNTAIN INC	5.61	5.61	227	25,470
VEREIT INC	22.3	22.3	175	19,614
PROLOGIS INC	12.262	12.262	810	90,859
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.7	2.1	266	29,876
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	2.15	196	22,064
DUKE REALTY CORP	8	8	229	25,681
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.48	1.48	366	41,073
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1.6	1.6	211	23,682
WELLTOWER INC	8.3	8.4	565	63,325
HCP INC	10.7	10.7	287	32,251
LIBERTY PROPERTY TRUST	3.3	3.3	147	16,498

銘柄	柄	期首		当期		期末	
		□ 数	□ 数	□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額
		千□	千□	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円
MID-AMERICA APARTMENT COMM		1.7	2.6	265	29,788		
MACERICH CO/THE		3	2.7	173	19,431		
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		23.2	26.6	313	35,080		
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		—	3.4	140	15,760		
REALTY INCOME CORP		6	6.45	357	40,089		
PUBLIC STORAGE		3.4	3.6	756	84,814		
REGENCY CENTERS CORP		2.3	3.5	238	26,667		
SL GREEN REALTY CORP		2.25	2.25	230	25,773		
UDR INC		6.3	6.3	247	27,784		
DIGITAL REALTY TRUST INC		3.7	4.75	555	62,266		
EXTRA SPACE STORAGE INC		2.75	3	255	28,592		
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額	258.378	287.678	16,270	1,823,151		
	銘柄数 < 比率 >	36銘柄	39銘柄		<1.9% >		
		千□	千□	千カナダ・ドル	千円		
(カナダ)							
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		1.5	1.5	43	3,809		
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		3	3	62	5,482		
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		3.3	3.9	96	8,444		
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額	7.8	8.4	203	17,736		
	銘柄数 < 比率 >	3銘柄	3銘柄		<0.0% >		
		千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円		
(オーストラリア)							
LENDLEASE GROUP		—	13.3	214	18,173		
TRANSURBAN GROUP		—	47.8	601	51,034		
SYDNEY AIRPORT		—	25.1	188	15,976		
APA GROUP		—	26.7	247	21,028		
SCENTRE GROUP		121.922	124.222	525	44,595		
DEXUS		23.95	23.95	244	20,753		
GPT GROUP		40.06	44.06	235	20,005		
MIRVAC GROUP		93.4	84.4	205	17,477		
STOCKLAND		57	57	266	22,639		
WESTFIELD CORP		45.496	45.496	380	32,280		
GOODMAN GROUP		41.7	41.7	363	30,825		
VICINITY CENTRES		74.873	76.973	213	18,160		
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額	498.401	610.701	3,687	312,951		
	銘柄数 < 比率 >	8銘柄	12銘柄		<0.3% >		
		千□	千□	千香港ドル	千円		
(香港)							
LINK REIT		52	52	3,658	52,495		
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		—	64.5	462	6,636		
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		—	87	860	12,347		
香港ドル通貨計	□ 数、金額	52	203.5	4,981	71,478		
	銘柄数 < 比率 >	1銘柄	3銘柄		<0.1% >		
		千□	千□	千シンガポール・ドル	千円		
(シンガポール)							
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		—	60.1	111	9,299		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		48	57.4	150	12,558		
CAPITALAND MALL TRUST		63.2	63.2	130	10,830		
SUNTEC REIT		53	53	106	8,818		
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額	164.2	233.7	498	41,506		
	銘柄数 < 比率 >	3銘柄	4銘柄		<0.0% >		
		千□	千□	千イギリス・ポンド	千円		
(イギリス)							
LAND SECURITIES GROUP PLC		18.2	17.062	158	23,853		
SEGRO PLC		19.95	23.75	130	19,619		
HAMMERSON PLC		17.4	19.2	99	14,907		
BRITISH LAND CO PLC		22.1	22.1	137	20,731		
INTU PROPERTIES PLC		21.1	21.1	41	6,175		
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額	98.75	103.212	567	85,287		
	銘柄数 < 比率 >	5銘柄	5銘柄		<0.1% >		
		千□	千□	千ユーロ	千円		
(ユーロ (フランス))							
UNIBAIL-RODAMCO SE		2.36	2.35	510	67,851		
ICADE		0.75	0.9	70	9,421		
GECINA SA		0.95	1.15	160	21,260		
KLEPIERRE		5.2	5.2	179	23,902		
FONCIERE DES REGIONS		0.75	0.75	66	8,894		
国小計	□ 数、金額	10.01	10.35	988	131,329		
	銘柄数 < 比率 >	5銘柄	5銘柄		<0.1% >		
合計	□ 数、金額	1,089.539	1,457.541	—	2,483,442		
	銘柄数 < 比率 >	61銘柄	71銘柄		<2.6% >		

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

(3)先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国 S&P500 E-MINI FUTURE (アメリカ)	百万円 1,735	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

2017年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 90,681,988	% 95.5
投資信託証券	2,483,442	2.6
コール・ローン等、その他	1,836,446	1.9
投資信託財産総額	95,001,876	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.05円、1カナダ・ドル=87.10円、1オーストラリア・ドル=84.87円、1香港ドル=14.35円、1シンガポール・ドル=83.19円、1ニュージーランド・ドル=76.68円、1イギリス・ポンド=150.33円、1イスラエル・シェケル=31.98円、1スイス・フラン=113.83円、1デンマーク・クローネ=17.84円、1ノルウェー・クローネ=13.58円、1スウェーデン・クローネ=13.38円、1ユーロ=132.81円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(94,407,006千円)の投資信託財産総額(95,001,876千円)に対する比率は、99.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

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

*期首における元本額は40,539,431,105円、当期中における追加設定元本額は5,901,304,959円、同解約元本額は6,706,629,096円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国株式インデックスV A565,889,975円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)18,626,936円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)281,422,814円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)32,623,332円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)908,478,453円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)399,976,869円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)900,220,105円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)305,036,599円、D-I's 外国株式インデックス992,761円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 175,432円、iFree 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)391,225,801円、iFree 8資産バランス291,084,495円、DCダイワ外国株式インデックス24,052,269,212円、ダイワ・ライフ・バランス30500,509,712円、ダイワ・ライフ・バランス50709,804,567円、ダイワ・ライフ・バランス70564,304,287円、大和DC海外株式インデックスファンド1,438,818,935円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 5,379,290円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 14,469,810円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 3,513,286円、ダイワ世界分散バランスファンド15VA81,383円、ダイワ世界分散バランスファンド20VA162,594円、ダイワ世界分散バランスファンド25VA2,143,628円、ダイワ世界分散バランスファンド30VA8,975,878円、ダイワ世界分散バランスファンド40VA506,282,561円、ダイワ世界分散バランスファンド60VA392,714,678円、ダイワ・バランスファンド35VA3,809,894,746円、ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)179,797,597円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式498,683,806円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド44,190,165円、ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)464,730円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス2,755,474,027円、ダイワライフスタイル2520,423,108円、ダイワライフスタイル5071,323,850円、ダイワライフスタイル7558,671,546円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は23,891円です。

■損益の状況

当 期 自 2016年12月1日 至 2017年11月30日

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

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

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

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

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス （為替ヘッジなし）

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2018年6月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）」は、このたび、第2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/>

<2730>

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	投資信託証券組入比率	純資産総額
	税込み 分配金	期中 騰落率					
1期末(2017年6月15日)	円 12,158	円 0	% 21.6	% 94.7	% 1.1	% 3.0	百万円 826
2期末(2018年6月15日)	円 13,778	円 0	% 13.3	% 93.2	% 1.3	% 4.3	1,697

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

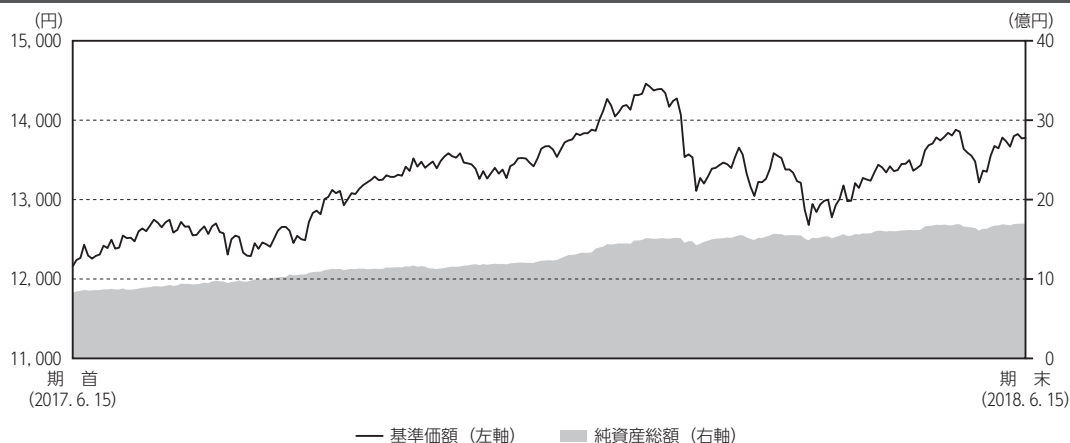
(注2) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(注3) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



運用経過

基準価額等の推移について



■ 基準価額・騰落率

期首：12,158円

期末：13,778円

騰落率：13.3%

■ 基準価額の主な変動要因

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

■ 組入ファンドの当期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国株式インデックスマザーファンド	14.4%	80.1%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	11.6%	19.1%

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証 券 組入比率
	円	騰 落 率			
(期首)2017年 6月15日	12,158	—	94.7	1.1	3.0
6 月末	12,383	1.9	94.5	1.2	3.1
7 月末	12,549	3.2	94.1	1.4	3.5
8 月末	12,608	3.7	93.9	1.6	3.3
9 月末	13,069	7.5	95.0	0.9	3.0
10月末	13,393	10.2	94.0	1.3	3.6
11月末	13,449	10.6	93.0	1.5	4.4
12月末	13,867	14.1	92.5	1.6	4.9
2018年 1月末	14,170	16.5	91.9	1.5	5.3
2 月末	13,567	11.6	92.8	1.5	4.7
3 月末	12,984	6.8	94.5	1.8	2.7
4 月末	13,448	10.6	94.4	1.3	3.5
5 月末	13,365	9.9	93.1	1.6	4.1
(期末)2018年 6月15日	13,778	13.3	93.2	1.3	4.3

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■先進国株式市況

米国・欧州を中心とする先進国株式市況は、期首より横ばいでの推移となりましたが、その後は米国企業の好調な決算発表や米国長期金利の上昇一服などから堅調に推移しました。2017年9月には、北朝鮮による6回目の核実験や米国南部に襲来した大型ハリケーンなど投資家心理が悪化する場面もありましたが、良好な決算発表や景況感の改善などを背景に、市況は底堅く推移しました。2018年1月には、米国株式市場が景気拡大や税制改革を好感して上昇したことで、市況はさらに上値を追う展開となりました。2月以降は、米国の利上げ加速への警戒感などから市況は下落し、その後も米中貿易摩擦が激化することへの懸念などを嫌気し、上値の重い展開となりました。5月以降も、米中貿易摩擦への懸念やイタリア政局の混迷などの悪材料を受け、力強さに欠ける展開のまま期末を迎えました。

■先進国為替相場

先進国為替相場は、期を通して、米ドルやユーロなどの主要通貨が対円で上昇(円安)しました。期首より、ECB(欧州中央銀行)の金融緩和姿勢の後退がユーロなどの上昇要因となりました。2017年9月に入ると、FOMC(米国連邦公開市場委員会)で2017年内の追加利上げの可能性が示唆されたことなどから円安傾向となりました。その後、主要通貨はおおむね横ばいで推移しましたが、2018年に入ると、米国のムニューシン財務長官による米ドル安容認発言などから米ドルが下落しました。2月には、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことや各国の株価が急落したことなどから市場のリスク回避姿勢が強まり、円は上昇傾向となりました。4月以降は、米国の金利が上昇したことなどから米ドルなどが上昇しました。一方、ユーロなどはイタリア情勢の影響から下落しました。

■新興国株式市況

新興国株式市況は、FRB(米国連邦準備制度理事会)の早期利上げ観測が後退したことや、エネルギー価格等の資源価格の上昇が好材料となり、2017年7月以降上昇基調となりました。9月から11月にかけては一時ボックス圏での推移となったものの、12月からは、米国株式市場の上昇と中国などの堅調な景気動向を受けて、大幅に上昇しました。しかし2018年2月に入ると、米国の金利上昇を要因とした米国株式市場の急落を受けて新興国市場から資金が流出したため、下落に転じました。その後も、米国トランプ政権の貿易政策に対する懸念などで、新興国株式市場は上値が重い展開のまま期末を迎えました。

国別では、2017年GDP（国内総生産）成長率が2016年を上回るなど堅調な内需を受けた中国株式市場が上昇しました。また、資源価格の上昇を受けて、ロシア株式市場、南アフリカ株式市場、ブラジル株式市場なども堅調でした。一方、政府の経済政策や中央銀行への干渉が懸念材料となったトルコ株式市場は下落しました。

■新興国為替相場

新興国為替相場は、米国金利の上昇を受けて一部のアジア通貨を除いて対米ドルで下落しました。通貨別では、堅調な国内景気と米国との貿易摩擦の激化が材料となって中国・人民元は買われました。また一部のアジア通貨も、中国景気の堅調さを好感し上昇しました。一方、中央銀行の独立性に対する懸念と米国金利の上昇が要因となり国外への資金流出が加速したことで、トルコ・リラは急落しました。NAFTA（北米自由貿易協定）再交渉問題が悪材料となったメキシコ・ペソ、シリア問題で米国との対立が激化したことが嫌気されたロシア・ルーブル、燃料価格の上昇に端を発したトラック運転手のストなどによる経済的混乱を受けてブラジル・レアルも売られました。なお、期を通じて円が対米ドルで小幅な動きとなったことから、新興国通貨は対米ドル同様、対円でも人民元など一部のアジア通貨を除いて新興国通貨安となりました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

引き続き、海外の株価指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行なってまいります。

■外国株式インデックスマザーファンド

引き続き、ベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ベース））の動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

引き続き、主として新興国の株式（DR（預託証券）を含む。）に投資し、投資成果をベンチマーク（FTSE RAFI エマージングインデックス（円換算））の動きに連動させることをめざして運用を行なってまいります。

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

ポートフォリオについて

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

外国株式を中心に、S & P 500先物取引も一部利用し、株式組入比率（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。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

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

また、効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすE T Fにも一部投資し、リバランス時には株価指数先物も利用しました。さらに、2018年3月以降は、新興国株式の実質的な組入比率を引き上げるため、先物取引をリバランス時以外でも利用しました。

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年6月16日 ～2018年6月15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)	3,778

- (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

海外の株価指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行なってまいります。

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

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

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2017.6.16~2018.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	59円	0.448%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は13,255円です。
(投信会社)	(42)	(0.319)	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)	(14)	(0.108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(3)	(0.022)	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	3	0.019	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 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)	(2)	(0.014)	
(先物)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.004)	
有価証券取引税	2	0.013	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)	(2)	(0.013)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	15	0.115	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)	(13)	(0.100)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(1)	(0.009)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	79	0.595	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含まず。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口数 千口	金額 千円	口数 千口	金額 千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	104,943	166,780	12,215	19,780
外国株式インデックスマザーファンド	283,116	666,155	38,365	90,779

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口数 千口	口数 千口	評価額 千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	115,219	207,947	324,522
外国株式インデックスマザーファンド	303,803	548,554	1,359,921

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

項 目	当 期	
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	2,313,736千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,908,633千円	
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.59	
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	12,346,089千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	90,461,983千円	
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.13	

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	324,522	19.1
外国株式インデックスマザーファンド	1,359,921	79.9
コール・ローン等、その他	17,012	1.0
投資信託財産総額	1,701,456	100.0

- (注1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.68円、1カナダ・ドル=84.33円、1オーストラリア・ドル=82.53円、1香港ドル=14.10円、1シンガポール・ドル=82.20円、1ニュージランド・ドル=76.93円、1台湾ドル=3.70円、1イギリス・ポンド=146.66円、1イスラエル・シケル=30.62円、1スイス・フラン=110.92円、1トルコ・リラ=23.39円、1デンマーク・クローネ=17.17円、1ノルウェー・クローネ=13.60円、1スウェーデン・クローネ=12.64円、1メキシコ・ペソ=5.31円、100チリ・ペソ=17.40円、1インド・ルピー=1.65円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1ブラジル・レアル=29.07円、1マレーシア・リンギット=27.78円、1南アフリカ・ランド=8.22円、1タイ・バーツ=3.42円、1ポーランド・ズロチ=29.84円、1ユーロ=127.90円です。
 (注3) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(5,284,620千円)の投資信託財産総額(5,337,173千円)に対する比率は、99.0%です。
 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(103,482,398千円)の投資信託財産総額(103,704,052千円)に対する比率は、99.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,701,456,179円
コール・ローン等	17,012,671
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド(評価額)	324,522,295
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	1,359,921,213
(B) 負債	3,462,924
未払信託報酬	3,421,565
その他未払費用	41,359
(C) 純資産総額(A-B)	1,697,993,255
元本	1,232,384,733
次期繰越損益金	465,608,522
(D) 受益権総口数	1,232,384,733口
1万口当り基準価額(C/D)	13,778円

- *期首における元本額は679,453,477円、当期中における追加設定元本額は695,338,362円、同解約元本額は142,407,106円です。
 *当期末の計算口数当りの純資産額は13,778円です。

<補足情報>

当ファンド(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))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(2017年11月30日)と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日(2018年6月15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掲載いたしました。75~93ページをご参照ください。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6,982円
受取利息	384
支払利息	△ 7,366
(B) 有価証券売買損益	128,842,850
売買益	142,280,494
売買損	△ 13,437,644
(C) 信託報酬等	△ 5,848,511
(D) 当期損益金(A+B+C)	122,987,357
(E) 前期繰越損益金	40,190,527
(F) 追加信託差損益金	302,430,638
(追加等相当額)	(44,940,814)
(売買損益相当額)	(257,489,824)
(G) 合計(D+E+F)	465,608,522
次期繰越損益金(G)	465,608,522
追加信託差損益金(配当等相当額)	(44,940,814)
(売買損益相当額)	(257,489,824)
分配準備積立金	163,184,866
繰越損益金	△ 6,982

- (注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
 (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
 (注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	122,993,019
(c) 収益調整金	302,430,638
(d) 分配準備積立金	40,191,847
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	465,615,504
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	465,615,504
(h) 受益権総口数	1,232,384,733口

★「外国株式インデックスマザーファンド」の第18期にかかる運用状況については94~115ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の決算日（2017年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15日）現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を123～129ページに併せて掲載いたしました。

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

(1) 株式

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	千株 652	千円 69,854	円 107	CHINA EVERGRANDE GROUP (ケイマン諸島)	千株 59	千円 20,673	円 350
HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	169	58,185	344	PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	23.1	17,313	749
CHINA MOBILE LTD (香港)	53	55,144	1,040	NASPERS LTD-N SHS (南アフリカ)	0.54	16,517	30,588
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	52	44,599	857	MTN GROUP LTD (南アフリカ)	13.55	14,931	1,101
BANK OF CHINA LTD-H (中国)	745	43,611	58	RELIANCE INDUSTRIES LTD (インド)	9.73	14,420	1,482
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H (中国)	376	32,633	86	PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	9.5	11,543	1,215
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	357	30,491	85	VALE SA (ブラジル)	7.7	10,445	1,356
GAZPROM PAO -SPON ADR (ロシア)	55.08	26,928	488	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV (オランダ)	365.93	9,862	26
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	15.6	24,210	1,551	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO (ケイマン諸島)	44	9,838	223
BANCO DO BRASIL S. A. (ブラジル)	15.8	20,527	1,299	STANDARD BANK GROUP LTD (南アフリカ)	4.09	8,207	2,006

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	千口 639.5	千円 1,571,355	円 2,457	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	千口 430.5	千円 1,085,447	円 2,521
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	16.1	2,723	169				
REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)	20.26	2,076	102				
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)	6.64	1,507	227				

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年6月15日現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド(3,410,057千口)の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	柄	2018年6月15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	
(アメリカ)					
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF		151	76	8,423	エネルギー
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR		8	168	18,670	情報技術
BAIDU INC - SPON ADR		4	108	11,981	情報技術
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR		168.5	156	17,325	電気通信サービス
JD. COM INC-ADR		10	43	4,842	一般消費財・サービス
NETEASE INC-ADR		1	25	2,822	情報技術
CTRIIP. COM INTERNATIONAL-ADR		8	40	4,528	一般消費財・サービス
VTB BANK JSC -GDR-REG S		797.14	111	12,351	金融
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR		32.9	204	22,649	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR		140.5	64	7,122	エネルギー
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR		67	120	13,348	素材
SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR		120.2	37	4,198	電気通信サービス
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS		107.6	192	21,275	生活必需品
MEGAFON-REG S GDR		61.8	54	6,005	電気通信サービス
RUSHYDRO PJSC-ADR		329.1	36	4,006	公益事業
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR		345.9	490	54,325	金融
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S		8.6	119	13,230	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR		122.7	806	89,277	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR		380.4	231	25,648	エネルギー
GAZPROM PAO -SPON ADR		2,194.7	970	107,365	エネルギー
SEVERSTAL - GDR REG S		39.3	64	7,177	素材
TATNEFT-PREF 3 SERIES		20	14	1,639	エネルギー
ALROSA PJSC		315.9	44	4,959	素材
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ		175.09	31	3,433	金融
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B		177	24	2,719	エネルギー
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	5,786.33	4,240	469,329	
	銘柄数 < 比率 >	25銘柄		< 8.8% >	

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千香港ドル	千円		
(香港)				
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	665	581	8,195	資本財・サービス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,030	643	9,076	資本財・サービス
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	200	343	4,844	資本財・サービス
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	125	392	5,534	情報技術
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	150	351	4,959	一般消費財・サービス
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	280	1,078	15,199	生活必需品
JIANGXI COPPER CO LTD-H	320	371	5,242	素材
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	8,478	6,171	87,024	エネルギー
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	90	376	5,304	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	560	498	7,035	一般消費財・サービス
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	3,650	306	4,323	一般消費財・サービス
FOSUN INTERNATIONAL LTD	280	468	6,601	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	48	1,977	27,884	情報技術
CHINA TELECOM CORP LTD-H	4,460	1,623	22,890	電気通信サービス
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	920	359	5,072	一般消費財・サービス
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	1,260	1,272	17,943	電気通信サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	270	699	9,860	不動産
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	660	291	4,113	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	600	956	13,485	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	4,920	3,011	42,455	エネルギー
CNOOC LTD	3,750	4,905	69,160	エネルギー
HUANENG POWER INTL INC-H	1,620	926	13,065	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	105	519	7,328	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	690	469	6,625	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	18,680	14,701	207,286	金融
CHINA MOBILE LTD	1,065	7,502	105,791	電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	158	461	6,505	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,960	1,017	14,343	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	168	244	3,444	金融
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	1,760	454	6,402	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	60	468	6,598	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,040	559	7,889	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	680	1,438	20,278	エネルギー
SINOPHARM GROUP CO-H	216	724	10,217	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	340	984	13,878	不動産
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	110	319	4,497	一般消費財・サービス
YANZHOU COAL MINING CO-H	200	232	3,271	エネルギー
BYD CO LTD-H	40	209	2,949	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	5,740	2,318	32,697	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	81	307	4,339	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,950	780	10,998	金融
CITIC LTD	640	743	10,485	資本財・サービス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	2,240	629	8,875	金融
IND & COMM BK OF CHINA-H	14,000	8,932	125,941	金融
LEGEND HOLDINGS CORP-H	148	369	5,206	情報技術
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	320	358	5,053	ヘルスケア
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	47.12	34	485	その他
GUANGDONG INVESTMENT LTD	280	370	5,219	公益事業
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	520	1,482	20,896	不動産
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1,030	866	12,213	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H	1,400	296	4,184	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	335	2,648	37,339	金融
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	100	324	4,568	不動産
YUJEXIU PROPERTY CO LTD	1,980	326	4,606	不動産
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,259	908	12,816	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	410	661	9,330	不動産
CHINA VANKE CO LTD-H	113	346	4,891	不動産
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	800	1,120	15,792	金融
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	465	336	4,746	一般消費財・サービス
CHINA POWER INTERNATIONAL	1,930	403	5,687	公益事業
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	350	283	3,992	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,000	402	5,668	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	266	937	13,220	金融
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	700	1,557	21,960	金融
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	60	457	6,446	公益事業
KUNLUN ENERGY CO LTD	620	436	6,154	エネルギー
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	236	433	6,116	不動産
LENOVO GROUP LTD	3,540	1,500	21,163	情報技術
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	1,400	1,332	18,792	素材
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	2,121	1,344	18,960	金融
CHINA EVERGRANDE GROUP	270	616	8,698	不動産
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	700	377	5,319	不動産
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	320	502	7,083	不動産
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	590	308	4,350	金融
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3,100	244	3,453	情報技術
CHINA MERCHANTS BANK-H	480	1,524	21,488	金融
BANK OF CHINA LTD-H	18,050	7,418	104,601	金融
SOHO CHINA LTD	620	246	3,470	不動産
CITIC SECURITIES CO LTD-H	220	424	5,980	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	720	280	3,949	金融

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	百株 412	千香港ドル 388	千円 5,483	金融
LONGFOR PROPERTIES	165	415	5,862	不動産
香港ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	133,336.12 82銘柄	1,465,177 <27.5%>	
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	325	31	2,577	資本財・サービス
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	325 1銘柄	31 <0.0%>	
(台湾)	百株	千台湾ドル	千円	
TAIWAN CEMENT	660	2,963	10,964	素材
ASIA CEMENT CORP	380	1,269	4,696	素材
ASE INDUSTRIAL HOLDING CO LT	539.64	4,020	14,875	情報技術
CATHAY FINANCIAL HOLDI-PFD B	47.52	—	—	金融
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	461.12	3,343	12,369	生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP	446	4,749	17,574	素材
NAN YA PLASTICS CORP	471.4	3,969	14,685	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	413.9	4,697	17,381	素材
WALSIN LIHWA CORP	720	1,738	6,433	資本財・サービス
CHINA STEEL CORP	1,066.86	2,528	9,355	素材
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	292.55	1,366	5,054	一般消費財・サービス
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	486.16	1,908	7,060	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC	280	3,192	11,810	情報技術
ACER INC	750	1,953	7,228	情報技術
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	191.41	1,443	5,339	情報技術
INVENTEC CORP	650	1,573	5,820	情報技術
TATUNG CO LTD	470	1,160	4,295	一般消費財・サービス
QUANTA COMPUTER INC	480	2,616	9,679	情報技術
AU OPTRONICS CORP	3,530	4,694	17,371	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	504	5,493	20,326	電気通信サービス
MEDIATEK INC	210.03	6,615	24,478	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	80	2,752	10,182	情報技術
HTC CORP	182.57	1,086	4,019	情報技術
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	388.22	1,238	4,582	金融
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,064.11	5,629	20,827	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,136.93	6,196	22,926	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,170	2,419	8,952	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	851.2	1,821	6,739	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,488.28	2,083	7,709	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,049.93	2,792	10,333	金融
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	991.78	1,433	5,302	金融
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,830.41	2,187	8,093	金融
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,040	1,170	4,329	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	2,580.28	5,650	20,908	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	952.58	1,971	7,295	金融
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	100	1,450	5,365	情報技術
TAIWAN MOBILE CO LTD	190	2,090	7,733	電気通信サービス
WISTRON CORP	1,079.4	2,525	9,345	情報技術
INNOLUX CORP	3,780	4,517	16,713	情報技術
TPK HOLDING CO LTD	160	1,048	3,877	情報技術
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	210	1,614	5,975	電気通信サービス
PEGATRON CORP	660	4,389	16,239	情報技術
CHAILEASE HOLDING CO LTD	110	1,171	4,334	金融
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	600	1,074	3,973	金融
POWERTECH TECHNOLOGY INC	114	1,027	3,800	情報技術
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	140	1,673	6,190	エネルギー
POU CHEN	274.4	1,013	3,751	一般消費財・サービス
COMPAL ELECTRONICS	614.53	1,204	4,456	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,600	36,240	134,088	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY	3,101.28	26,515	98,108	情報技術
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	50	1,567	5,799	生活必需品
ASUSTEK COMPUTER INC	87.6	2,461	9,107	情報技術
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	630	1,798	6,655	資本財・サービス
UNITED MICROELECTRONICS CORP	2,920	5,285	19,555	情報技術
台湾ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	45,278.09 54銘柄	198,398 <13.8%>	
(トルコ)	百株	千トルコ・リラ	千円	
TURKIYE GARANTI BANKASI	368	305	7,152	金融
AKBANK T. A. S.	408.5	296	6,927	金融
TURKIYE IS BANKASI-C	411.2	239	5,607	金融
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	194.3	225	5,276	電気通信サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	28.7	321	7,518	エネルギー
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	197.41	208	4,885	素材
HACI OMER SABANCI HOLDING	294.4	262	6,149	金融
TURKIYE HALK BANKASI	294.9	212	4,980	金融
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	271.7	132	3,107	金融
KOC HOLDING AS	203.15	283	6,628	資本財・サービス

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
TURK HAVA YOLLARI AO BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	百株 108.7 22.7	千トルコ・リラ 139 156	千円 3,269 3,658	資本財・サービス 生活必需品
トルコ・リラ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,803.66 12銘柄	2,785 <1.2%>	65,160
(メキシコ)	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	5,166	8,570	45,508	電気通信サービス
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	274	2,067	10,980	一般消費財・サービス
CEMEX SAB-CPO	3,502.19	4,514	23,971	素材
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	220	3,844	20,414	生活必需品
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	73	882	4,686	生活必需品
MEXICHEM SAB DE CV-*	138.23	768	4,082	素材
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	157	576	3,062	生活必需品
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14.75	508	2,702	素材
ALFA S. A. B. -A	625	1,375	7,304	資本財・サービス
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	507	2,996	15,913	素材
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	639	3,237	17,192	生活必需品
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	237	2,622	13,926	金融
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,553.17 12銘柄	31,967 <3.2%>	169,745
(チリ)	百株	千チリ・ペソ	千円	
ENEL CHILE SA	2,290.97	15,585	2,711	公益事業
BANCO DE CREDITO E INVERSION	4.7	20,623	3,588	金融
LATAM AIRLINES GROUP SA	40.9	31,118	5,414	資本財・サービス
CENCOSUD SA	278.7	48,100	8,369	生活必需品
BANCO SANTANDER CHILE	7,526.8	38,213	6,649	金融
ENEL AMERICAS SA	3,468.2	41,351	7,195	公益事業
EMPRESAS CMPC SA	138.2	33,889	5,896	素材
S. A. C. I. FALABELLA	41.1	25,074	4,362	一般消費財・サービス
EMPRESAS COPEC SA	37	37,303	6,490	エネルギー
BANCO DE CHILE	2,643.46	26,680	4,642	金融
チリ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	16,470.03 10銘柄	317,941 <1.0%>	55,321
(インド)	百株	千インド・ルピー	千円	
RAJESH EXPORTS LTD	34	2,040	3,366	一般消費財・サービス
TATA STEEL LTD	53.2	3,030	4,999	素材
AXIS BANK LTD	147	7,820	12,903	金融
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	4	3,583	5,912	一般消費財・サービス
HINDUSTAN UNILEVER LTD	22.6	3,637	6,002	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	163.9	5,076	8,376	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	353.3	9,984	16,474	金融
NTPC LTD	337.9	5,352	8,831	公益事業
JSW STEEL LTD	113.6	3,851	6,355	素材
INDIAN OIL CORP LTD	652.8	11,198	18,477	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	203.65	8,478	13,990	エネルギー
IDEA CELLULAR LTD	304.3	1,911	3,153	電気通信サービス
YES BANK LTD	94.5	3,186	5,257	金融
TATA MOTORS LTD-A-DVR	87	1,591	2,626	一般消費財・サービス
RURAL ELECTRIFICATION CORP	200.2	2,332	3,848	金融
COAL INDIA LTD	223.2	6,321	10,429	エネルギー
BHARTI INFRA TEL LTD	72.4	2,146	3,541	電気通信サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	25.3	3,001	4,951	金融
GAIL INDIA LTD	64.93	2,201	3,631	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD	170.1	4,163	6,869	素材
GRASIM INDUSTRIES LTD	26.4	2,735	4,513	素材
WIPRO LTD	97.2	2,589	4,272	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	54.36	9,717	16,033	情報技術
INFOSYS LTD	142	17,603	29,046	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD	25.52	3,427	5,655	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD	227.2	6,950	11,467	一般消費財・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	75.7	13,881	22,904	金融
ICICI BANK LTD	95.64	2,723	4,493	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD	280.4	28,262	46,633	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	611.95	10,311	17,013	エネルギー
ITC LTD	163.6	4,372	7,214	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	53.2	4,905	8,093	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD	7.7	2,845	4,695	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD	150.8	5,677	9,368	電気通信サービス
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	55.2	3,087	5,093	ヘルスケア
HCL TECHNOLOGIES LTD	39.9	3,738	6,168	情報技術
VEDANTA LTD	209.5	5,029	8,297	素材
インド・ルピー通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,644.15 37銘柄	218,766 <6.8%>	360,964
(インドネシア)	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
UNITED TRACTORS TBK PT	151	525,480	4,203	エネルギー
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,840	1,269,600	10,156	一般消費財・サービス

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	635	441,325	3,530	生活必需品
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	5,292	1,910,412	15,283	電気通信サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	790	635,950	5,087	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	425	945,625	7,565	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,739	1,208,605	9,668	金融
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	2,987	621,296	4,970	公益事業
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	4,675	1,467,950	11,743	金融
インドネシア・ルピア通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	18,534 9銘柄	9,026,243 <1.4%>	72,209
	百株	千ブラジル・リアル	千円	
(ブラジル)				
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	12	23	683	公益事業
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	121	202	5,874	一般消費財・サービス
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	863	1,303	37,881	エネルギー
BANCO BRADESCO SA-PREF	527.34	1,333	38,768	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	503.24	1,916	55,722	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	157	128	3,742	素材
VALE SA	507.9	2,626	76,348	素材
GERDAU SA-PREF	215	306	8,918	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	673	1,210	35,176	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	646.97	432	12,582	公益事業
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	309.41	272	7,933	金融
BRASKEM SA-PREF A	35	143	4,183	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	56	91	2,661	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	372	941	27,359	金融
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	26	90	2,637	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	79	112	3,258	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	59	134	3,922	公益事業
EMBRAER SA	127	314	9,155	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF	491	311	9,049	素材
CCR SA	140	147	4,273	資本財・サービス
BRF SA	129	269	7,826	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	57	133	3,890	公益事業
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	77	123	3,576	公益事業
TIM PARTICIPACOES SA	123.26	160	4,672	電気通信サービス
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	83	385	11,193	電気通信サービス
LOJAS RENNEN S. A.	38.5	108	3,167	一般消費財・サービス
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	66	102	2,993	一般消費財・サービス
JBS SA	504	443	12,878	生活必需品
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	49	235	6,837	素材
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	120	241	7,029	金融
BR MALLS PARTICIPACOES SA	113.08	105	3,073	不動産
CIELO SA	99.28	152	4,424	情報技術
FIBRIA CELULOSE SA	27	198	5,761	素材
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	45	342	9,941	生活必需品
GERDAU S. A.	21	22	653	素材
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	56	34	1,009	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	74	217	6,324	金融
KLABIN SA - UNIT	66	135	3,931	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	70	339	9,861	エネルギー
LOJAS AMERICANAS SA	19	22	662	一般消費財・サービス
KROTON EDUCACIONAL SA	130	132	3,839	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S. A.	139.88	318	9,250	金融
AMBEV SA	367	694	20,195	生活必需品
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,394.86 43銘柄	16,963 <9.3%>	493,128
	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
(マレーシア)				
MALAYAN BANKING BHD	727	697	19,388	金融
GENTING BHD	204	174	4,845	一般消費財・サービス
PUBLIC BANK BERHAD	272	653	18,165	金融
SIME DARBY BERHAD	699	181	5,048	資本財・サービス
AXIATA GROUP BERHAD	425	202	5,631	電気通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	297	247	6,881	素材
GENTING MALAYSIA BHD	302	153	4,270	一般消費財・サービス
IOI CORP BHD	295	138	3,851	生活必需品
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	825	492	13,682	金融
SIME DARBY PLANTATION BHD	278	153	4,255	生活必需品
TENAGA NASIONAL BHD	575	833	23,161	公益事業
DIGI.COM BHD	269	120	3,347	電気通信サービス
SAPURA ENERGY BHD	2,511	163	4,534	エネルギー
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	7,679 13銘柄	4,213 <2.2%>	117,063
	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
(南アフリカ)				
GOLD FIELDS LTD	208.6	1,032	8,484	素材
VODACOM GROUP LTD	72.4	1,002	8,242	電気通信サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD	38.4	910	7,480	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD	32.8	904	7,436	金融

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
BIDVEST GROUP LTD	24.2	502	4,133	資本財・サービス
BID CORP LTD	31.7	887	7,298	生活必需品
NETCARE LTD	188.4	545	4,487	ヘルスケア
STANDARD BANK GROUP LTD	166.5	3,462	28,463	金融
IMPERIAL HOLDINGS LTD	36.4	740	6,088	一般消費財・サービス
SASOL LTD	110	5,346	43,944	素材
REMGRO LTD	37.8	778	6,400	金融
EXXARO RESOURCES LTD	34.8	456	3,753	エネルギー
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	41.6	345	2,838	一般消費財・サービス
SANLAM LTD	161.7	1,202	9,885	金融
TIGER BRANDS LTD	12.5	408	3,359	生活必需品
FIRSTRAND LTD	288.5	1,823	14,992	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	121.8	689	5,671	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	16.8	318	2,616	一般消費財・サービス
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	128.4	2,127	17,486	金融
NASPERS LTD-N SHS	5.9	1,967	16,174	一般消費財・サービス
INVESTEC LTD	44.4	443	3,642	金融
MTN GROUP LTD	282.1	3,187	26,203	電気通信サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	187.8	431	3,550	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	20.4	545	4,484	ヘルスケア
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	72.3	833	6,854	素材
BARLOWORLD LTD	39.6	531	4,370	資本財・サービス
SAPPI LIMITED	88.4	811	6,666	素材
TELKOM SA SOC LTD	86.7	464	3,814	電気通信サービス
MONDI LTD	13.2	486	3,998	素材
MMI HOLDINGS LTD	166	306	2,517	金融
SPAR GROUP LIMITED/THE	27.4	520	4,279	生活必需品
MR PRICE GROUP LTD	15.9	389	3,202	一般消費財・サービス
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	159.9	415	3,418	ヘルスケア
SIBANYE GOLD LTD	318.7	274	2,252	素材
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,282 34銘柄	35,096 <5.4%>	288,493
(タイ)	百株	千タイ・パーツ	千円	
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	73	1,518	5,192	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	115	4,991	17,069	素材
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	135	2,794	9,557	金融
KASIKORN BANK PCL-NVDR	97	1,940	6,634	金融
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	318	4,293	14,682	金融
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	211	1,065	3,644	金融
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	165	3,118	10,665	電気通信サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	1,165	2,062	7,052	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	748	1,630	5,576	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	282	3,835	13,116	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	1,558	989	3,383	エネルギー
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	291	1,025	3,508	エネルギー
PTT PCL-NVDR	2,790	14,229	48,663	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	193	1,572	5,379	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	257	2,030	6,943	生活必需品
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,061	2,679	9,162	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	331	2,772	9,480	素材
タイ・パーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,790 17銘柄	52,547 <3.4%>	179,711
(ポーランド)	百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
PKO BANK POLSKI SA	81.8	327	9,763	金融
BANK PEKAO SA	31.2	374	11,167	金融
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	101.2	382	11,414	金融
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	227.9	134	4,012	エネルギー
PGE SA	118.7	121	3,637	公益事業
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	51.1	435	13,009	エネルギー
KGHM POLSKA MIEDZ SA	29.9	275	8,217	素材
ポーランド・ズロチ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	641.8 7銘柄	2,051 <1.2%>	61,223
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	269,518.21 356銘柄	— <85.2%>	4,534,181

(注1) 邦貨換算金額は、2018年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売相場の中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	柄	2018年6月15日現在		
		□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)		千□	千アメリカ・ドル	千円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M		274	5,858	648,376
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金 額	274	5,858	648,376
	銘柄数 < 比率 >	1 銘柄		<12.2%>
(メキシコ)		千□	千メキシコ・ペソ	千円
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		38.6	1,068	5,671
メキシコ・ペソ通貨計	□ 数、金 額	38.6	1,068	5,671
	銘柄数 < 比率 >	1 銘柄		<0.1%>
(南アフリカ)		千□	千南アフリカ・ランド	千円
REDEFINE PROPERTIES LTD		50.98	551	4,529
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		29.13	792	6,510
南アフリカ・ランド通貨計	□ 数、金 額	80.11	1,343	11,040
	銘柄数 < 比率 >	2 銘柄		<0.2%>
合 計	□ 数、金 額	392.71	—	665,088
	銘柄数 < 比率 >	4 銘柄		<12.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、2018年6月15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	2018年6月15日現在	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
MSCI EMG MKT (アメリカ)	36	—

(注1) 外貨建の評価額は、2018年6月15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。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第7期 (決算日 2017年7月5日)

(計算期間 2016年7月6日～2017年7月5日)

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの第7期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	1. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 (上場予定および店頭登録予定を含みます) 2. 新興国の企業のDR (預託証券) 3. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF (上場投資信託証券)
運用方法	①主として、新興国の株式 (DRを含みます。以下同じ。) (※) に投資し、投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 ※効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETFに投資する場合があります。 ②株式およびETFの組入比率の合計は、通常の状態で信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。 ③運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
株式組入制限	無制限

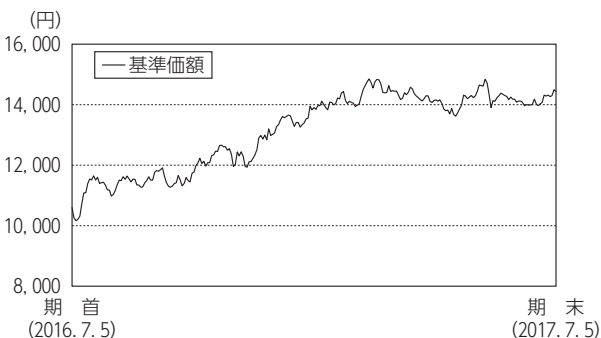
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,600円 期末：14,435円 騰落率：36.2%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークであるFTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) に連動させることをめざした運用を行なった結果、新興国株式がアジアを中心に全体として上昇基調だったことや、為替相場で円安が進んだことからベンチマークが上昇し、当ファンドの基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○新興国株式市況

新興国株式市況は、期を通じてはアジアを中心に上昇しました。新興国株式市況は、期首より、日欧での追加金融緩和への期待が高まったことなどから、リスクを取る動きが強まり上昇しました。2016年11月にトランプ氏が米国大統領選挙に勝利してからは、米国の財政支出拡大が予想されたことから米国の株高と金利上昇が進み、それを受けて新興国からの資金流出が起こり新興国株は下落しました。特に、メキシコおよびブラジル株式市場は、トランプ大統領の保護主義が経済への悪影響となることが懸念されたこともあり軟調な推移となりました。12月下旬以降は、エネルギー価格の上昇や良好な米国および中国の経済指標、FRB (米国連邦準備制度理事会) の利上げペースが緩やかなものになるという見方が強まったことなどから、世界景気に対する安心感が広がり堅調に推移しました。2017年5月中旬からは、原油価格の下落や地政学リスクの上昇などにより、アジア圏を除き上値が重い展開となって期末を迎えました。

○為替相場

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

◆前期における「今後の運用方針」

主として、新興国の株式 (DR (預託証券) を含む。) に投資し、投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。また、効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF (上場投資信託証券) にも一部投資します。なお、株式およびETFの組入比率の合計は、通常の状態で信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。さらに、リバランス時等に、株式実質組入比率の維持を目的に株価指数先物取引の利用も検討します。また、保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) は、FTSE International Limited の承諾を得て、FTSE RAFI エマージング インデックス (配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE International Limited と Research Affiliates LLC に帰属します。また、FTSE International Limited は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

また、配当金に対する課税分や保管費用等のコストが、マイナス要因となりました。

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

《今後の運用方針》

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

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

■ 1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2016年7月6日から2017年7月5日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2016年7月6日から2017年7月5日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2016年7月6日から2017年7月5日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円 678	百万円 679	百万円 —	百万円 —
株 式 先 物 取 引				

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1)株 式

(2016年7月6日から2017年7月5日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2)投資信託証券

(2016年7月6日から2017年7月5日まで)

銘柄	当 期			期 末		
	口 数	金 額	平均単価	口 数	金 額	平均単価
POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT (アメリカ)	147	315,414	2,145	129	271,661	2,105
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	15.8	2,929	185			
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)	11.44	2,527	220			
REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)	14.3	1,356	94			

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国株式

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

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		
TENCENT HOLDINGS LTD	21	44	1,184	17,151	情報技術	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,180	2,440	897	13,001	電気通信サービス	
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	160	340	157	2,274	一般消費財・サービス	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	480	1,100	1,238	17,934	電気通信サービス	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	115	155	216	3,133	不動産	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	140	260	381	5,526	公益事業	
PETROCHINA CO LTD-H	1,560	3,280	1,607	23,272	エネルギー	
DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	90	—	—	—	情報技術	
CNOOC LTD	1,560	2,970	2,566	37,156	エネルギー	
HUANENG POWER INTL INC-H	320	740	398	5,775	公益事業	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	65	110	301	4,372	素材	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	190	310	172	2,504	公益事業	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	6,180	12,410	7,433	107,638	金融	
CHINA MOBILE LTD	255	545	4,477	64,829	電気通信サービス	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	64	174	333	4,822	金融	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	450	1,090	524	7,591	金融	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	100	—	—	—	不動産	
GF SECURITIES CO LTD-H	—	86	134	1,942	金融	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	20	40	231	3,350	生活必需品	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	—	580	266	3,863	金融	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	315	540	918	13,292	エネルギー	
SINOPHARM GROUP CO-H	44	100	347	5,024	ヘルスケア	
CHINA RESOURCES LAND LTD	100	260	582	8,433	不動産	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	—	110	213	3,096	一般消費財・サービス	
YANZHOU COAL MINING CO-H	—	260	175	2,545	エネルギー	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	100	—	—	—	資本財・サービス	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,080	3,760	1,394	20,199	金融	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	26	50	196	2,845	金融	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	410	1,020	336	4,873	金融	
CITIC LTD	320	410	477	6,910	資本財・サービス	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	450	940	263	3,811	金融	
IND & COMM BK OF CHINA-H	5,610	10,630	5,272	76,345	金融	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	80	140	146	2,120	公益事業	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	120	320	740	10,726	不動産	
CRRC CORP LTD - H	—	210	146	2,122	資本財・サービス	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	240	480	482	6,992	資本財・サービス	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	155	340	1,764	25,551	金融	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	130	200	320	4,645	不動産	
CHINA MINSHENG BANKING-H	324	774	600	8,697	金融	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	410	710	651	9,427	不動産	
CHINA VANKE CO LTD-H	—	108	249	3,612	不動産	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	140	560	741	10,736	金融	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	125	205	200	2,900	一般消費財・サービス	
WEICHAI POWER CO LTD-H	—	340	227	3,298	資本財・サービス	
CHINA POWER INTERNATIONAL	190	630	174	2,526	公益事業	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	—	520	215	3,117	素材	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	90	202	639	9,257	金融	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	230	420	989	14,322	金融	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	20	50	235	3,406	公益事業	
KUNLUN ENERGY CO LTD	200	380	259	3,752	エネルギー	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	96	232	288	4,172	不動産	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	—	220	140	2,035	エネルギー	
LENOVO GROUP LTD	460	1,680	831	12,041	情報技術	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	360	780	358	5,195	素材	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	621	1,231	679	9,839	金融	
CHINA EVERGRANDE GROUP	310	730	1,147	16,616	不動産	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	220	—	—	—	不動産	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	220	320	170	2,465	金融	
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	34	—	—	—	その他	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	780	2,040	169	2,451	情報技術	
CHINA MERCHANTS BANK-H	260	415	966	14,001	金融	
BANK OF CHINA LTD-H	6,150	10,860	4,181	60,542	金融	
SOHO CHINA LTD	195	—	—	—	不動産	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	60	155	247	3,586	金融	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	210	450	162	2,358	金融	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	68	180	227	3,289	金融	
LONGFOR PROPERTIES	75	170	295	4,283	不動産	
香港ドル通貨計	株数、金額	39,976	80,904	58,159	842,146	
	銘柄数 < 比率 >	70銘柄	76銘柄		< 26.1% >	
(台湾)	百株	百株	千台湾ドル	千円		
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	65	—	—	—	不動産	
TAIWAN CEMENT	120	200	709	2,630	素材	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	171.12	421.12	2,551	9,467	生活必需品	
FORMOSA PLASTICS CORP	116	286	2,659	9,867	素材	
NAN YA PLASTICS CORP	111.4	351.4	2,635	9,777	素材	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	83.9	283.9	2,731	10,132	素材	
CHINA STEEL CORP	426.86	806.86	2,057	7,633	素材	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	82.55	172.55	1,125	4,173	一般消費財・サービス	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	85.74	196.16	990	3,675	情報技術	
DELTA ELECTRONICS INC	80	130	2,099	7,789	情報技術	

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	千台湾ドル	千円	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	287.5	659.29	2,544	9,441	情報技術
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	60.81	91.41	836	3,103	情報技術
INVENTEC CORP	300	330	826	3,066	情報技術
TATUNG CO LTD	—	470	613	2,275	一般消費財・サービス
QUANTA COMPUTER INC	130	260	1,838	6,819	情報技術
AU OPTRONICS CORP	1,350	2,370	3,116	11,562	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	174	354	3,823	14,184	電気通信サービス
MEDIATEK INC	80.03	160.03	4,216	15,644	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	20	60	2,157	8,002	情報技術
HTC CORP	152.57	222.57	1,600	5,937	情報技術
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	169.4	356.17	1,086	4,030	金融
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	434.11	714.11	3,356	12,451	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	436.93	756.93	3,731	13,844	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	550.95	—	—	—	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	217.38	531.81	997	3,699	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	458.28	718.28	991	3,677	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	389.93	749.93	1,912	7,094	金融
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	374.89	605.76	842	3,123	金融
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	450.41	850.41	693	2,574	金融
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	364.15	—	—	—	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	722.49	1,480.28	2,975	11,038	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	307.2	718.22	1,461	5,422	金融
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	20	50	617	2,290	情報技術
TAIWAN MOBILE CO LTD	60	110	1,259	4,672	電気通信サービス
WISTRON CORP	386.58	588.14	1,785	6,622	情報技術
INNOLUX CORP	940	2,620	4,152	15,406	情報技術
TPK HOLDING CO LTD	60	80	739	2,742	情報技術
WPG HOLDINGS LTD	—	150	605	2,245	情報技術
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	60	120	943	3,499	電気通信サービス
PEGATRON CORP	150	340	3,287	12,197	情報技術
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	30	80	540	2,006	情報技術
POWERTECH TECHNOLOGY INC	44	74	691	2,566	情報技術
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	60	70	738	2,739	エネルギー
POU CHEN	154.4	144.4	624	2,317	一般消費財・サービス
SILICONWARE PRECISION INDS	90	120	593	2,201	情報技術
COMPAL ELECTRONICS	234.53	374.53	762	2,827	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	600	1,100	22,770	84,476	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY	610.26	1,441.28	16,286	60,422	情報技術
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	20	40	1,078	3,999	生活必需品
ASUSTEK COMPUTER INC	27.6	47.6	1,356	5,032	情報技術
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	132.6	—	—	—	資本財・サービス
UNITED MICROELECTRONICS CORP	700	1,150	1,633	6,058	情報技術
台湾ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	13,153.57 50銘柄	24,007.14 48銘柄	117,646 436,469	<13.5%>
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
TURKIYE GARANTI BANKASI	135.8	291.4	292	9,300	金融
AKBANK T. A. S.	122.3	270.9	270	8,603	金融
TURKIYE IS BANKASI-C	144	271.7	202	6,452	金融
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	52.4	98.5	114	3,644	電気通信サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	10.3	25.2	252	8,019	エネルギー
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	126.31	178.31	125	3,984	素材
HACI OMER SABANCI HOLDING	72.2	146.2	159	5,084	金融
TURKIYE HALK BANKASI	60.9	153.6	203	6,469	金融
YAPI VE KREDI BANKASI	69.8	173.7	79	2,540	金融
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	101.9	193.2	127	4,065	金融
KOC HOLDING AS	49.75	112.55	183	5,832	資本財・サービス
TURK HAVA YOLLARI AO	32	157.6	131	4,183	資本財・サービス
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	46.3	110	68	2,168	電気通信サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5.9	15.5	99	3,173	生活必需品
トルコ・リラ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,029.86 14銘柄	2,198.36 14銘柄	2,312 73,522	<2.3%>
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	1,854	4,864	7,120	44,291	電気通信サービス
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	59	151	1,356	8,436	一般消費財・サービス
CEMEX SAB-CPO	1,380.14	1,798.19	3,159	19,651	素材
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	46	155	2,715	16,891	生活必需品
GRUPO FIN SANTANDER-B	106	225	805	5,013	金融
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	16	42	649	4,038	生活必需品
MEXICHEM SAB DE CV*	49	110.23	528	3,286	素材
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	35	103	462	2,876	生活必需品
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	—	7.9	326	2,032	素材
ALFA S. A. B. -A	118	424	1,097	6,825	資本財・サービス
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	179	302	1,594	9,920	素材
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	68	157	486	3,026	金融
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	163	398	1,667	10,370	生活必需品
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	61	179	2,074	12,902	金融
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,134.14 13銘柄	8,916.32 14銘柄	24,045 149,563	<4.6%>
(チリ)	百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
ENEL CHILE SA	1,523.1	1,523.1	11,328	1,930	公益事業

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ENEL GENERACION CHILE SA	179.8	266.8	13,572	2,312	公益事業
ENDESA AMERICAS SA	179.8	—	—	—	その他
LATAM AIRLINES GROUP SA	14.8	28.8	21,727	3,702	資本財・サービス
CENCOSUD SA	37.3	93.4	16,558	2,821	生活必需品
BANCO SANTANDER CHILE	3,898.5	5,410.5	23,822	4,059	金融
ENEL AMERICAS SA	1,523.1	2,489.2	32,548	5,546	公益事業
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	—	5	11,548	1,967	素材
S. A. C. I. FALABELLA	19.1	19.1	10,615	1,808	一般消費財・サービス
BANCO DE CHILE	1,436.33	1,945.94	17,324	2,952	金融
チリ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,811.83 9銘柄	11,781.84 9銘柄	159,047 <0.8%>	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
TATA STEEL LTD	44	37.4	2,047	3,604	素材
AXIS BANK LTD	25.6	82.4	4,189	7,373	金融
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	—	2	1,475	2,596	一般消費財・サービス
HINDUSTAN UNILEVER LTD	8	17.6	1,915	3,370	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	17.3	63.4	3,245	5,711	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	145.2	194.5	5,309	9,345	金融
NTPC LTD	128.8	197.6	3,123	5,496	公益事業
JSW STEEL LTD	10	100	2,083	3,666	素材
INDIAN OIL CORP LTD	31.4	132.7	5,067	8,918	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	17.2	75.7	4,975	8,756	エネルギー
CAIRN INDIA LTD	47.9	—	—	—	その他
IDEA CELLULAR LTD	58.4	117.6	987	1,737	電気通信サービス
PUNJAB NATIONAL BANK	59	—	—	—	金融
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	13.7	—	—	—	公益事業
JINDAL STEEL & POWER LTD	99.5	—	—	—	素材
TATA MOTORS LTD-A-DVR	27.4	44.4	1,167	2,055	一般消費財・サービス
RURAL ELECTRIFICATION CORP	42.1	84.2	1,454	2,559	金融
COAL INDIA LTD	59.8	139.1	3,432	6,040	エネルギー
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	11.1	17.3	1,818	3,200	金融
GAIL INDIA LTD	19.2	29.5	1,077	1,896	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD	176.5	146.5	2,906	5,115	素材
WIPRO LTD	9.7	60.4	1,570	2,763	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	7	15.88	3,758	6,615	情報技術
INFOSYS LTD	38.8	87.8	8,447	14,867	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD	7.55	11.55	1,944	3,421	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD	70.1	114.3	4,879	8,587	一般消費財・サービス
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	70.1	—	—	—	資本財・サービス
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	124.8	283.8	594	1,046	電気通信サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	31.3	55.1	9,039	15,910	金融
HDFC BANK LIMITED	11.3	—	—	—	金融
ICICI BANK LTD	142.2	173.14	5,012	8,821	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD	80.6	153.7	21,855	38,465	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	93.5	385.75	6,168	10,855	エネルギー
ITC LTD	57.6	95.4	3,217	5,662	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	11.7	19.3	2,615	4,603	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD	2.7	4.7	1,740	3,063	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD	56.9	100.2	3,800	6,689	電気通信サービス
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	7.6	20.5	1,132	1,993	ヘルスケア
HCL TECHNOLOGIES LTD	—	18.2	1,531	2,695	情報技術
VEDANTA LTD	156.8	80.5	2,054	3,616	素材
インド・ルピー通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,022.35 38銘柄	3,162.12 34銘柄	125,639 <6.9%>	
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
UNITED TRACTORS TBK PT	98	125	356,250	3,028	エネルギー
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	904	1,312	1,151,280	9,785	一般消費財・サービス
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	111	—	—	—	素材
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	—	313	273,875	2,327	生活必需品
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	1,801	3,218	1,477,062	12,555	電気通信サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	332	520	341,900	2,906	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	214	438	812,490	6,906	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	338	664	896,400	7,619	金融
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	538	1,334	310,822	2,641	公益事業
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	316	779	1,191,870	10,130	金融
ADARO ENERGY TBK PT	—	1,327	209,666	1,782	エネルギー
インドネシア・ルピア通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,652 9銘柄	10,030 10銘柄	7,021,615 <1.8%>	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	1,663	826	1,026	35,072	エネルギー
VALE SA-PREF	706	300	821	28,048	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	315.37	337.4	952	32,525	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	352.13	356.24	1,315	44,940	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	101	100	72	2,462	素材
VALE SA	460	197	583	19,932	素材
GERDAU SA-PREF	218	172	178	6,087	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	1,397	716	953	32,578	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	165.97	239.97	195	6,680	公益事業

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	千ブラジル・レアル	千円		
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	224.29	192.29	173	5,918	金融	
BRASKEM SA-PREF A	18	18	61	2,112	素材	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	32	27	43	1,498	公益事業	
BANCO DO BRASIL S. A.	182	214	584	19,964	金融	
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	12	—	—	—	エネルギー	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	—	34	43	1,469	公益事業	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	21	24	59	2,022	公益事業	
EMBRAER SA	33	84	128	4,378	資本財・サービス	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	—	417	211	7,207	素材	
CCR SA	49	62	104	3,579	資本財・サービス	
BRF SA	37	67	262	8,962	生活必需品	
NATURA COSMETICOS SA	15	25	62	2,141	生活必需品	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	36	37	117	4,025	公益事業	
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	29	—	—	—	一般消費財・サービス	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	—	37	56	1,946	公益事業	
TIM PARTICIPACOES SA	97.26	104.26	102	3,515	電気通信サービス	
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	33	51	231	7,900	電気通信サービス	
CPFL ENERGIA SA	37.87	35.87	94	3,242	公益事業	
LOJAS RENNEN S. A.	24	32.5	88	3,039	一般消費財・サービス	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	19.2	—	—	—	一般消費財・サービス	
JBS SA	74	170	112	3,838	生活必需品	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	16	24	82	2,807	公益事業	
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	—	90	61	2,112	生活必需品	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	32	—	—	—	公益事業	
BM&FBOVESPA SA	110	84	166	5,692	金融	
AES TIETE ENERGIA SA-UNIT	23	—	—	—	公益事業	
PORTO SEGURO SA	12	—	—	—	金融	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	44.2	45.08	54	1,852	不動産	
CIELO SA	24.07	63.28	154	5,265	情報技術	
FIBRIA CELULOSE SA	13	27	89	3,048	素材	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	27	36	229	7,824	生活必需品	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	10	10	54	1,868	公益事業	
SUL AMERICA SA - UNITS	23	—	—	—	金融	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	46	45	114	3,910	金融	
KLABIN SA - UNIT	16	—	—	—	素材	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	25	43	332	11,367	エネルギー	
KROTON EDUCACIONAL SA	48	68	102	3,484	一般消費財・サービス	
BANCO BRADESCO S. A.	74.43	80.17	221	7,574	金融	
AMBEV SA	183	296	539	18,443	生活必需品	
GRUPO BTG PACTUAL-UNIT	—	30	46	1,578	金融	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	13	—	—	—	金融	
ブラジル・レアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	7,091.79 45銘柄	5,818.06 41銘柄	10,887	371,925 <11.5%>	
(マレーシア)		百株	百株	千マレーシア・リングギット	千円	
MISC BHD	67	—	—	—	資本財・サービス	
MALAYAN BANKING BHD	190	374	360	9,495	金融	
GENTING BHD	77	108	100	2,653	一般消費財・サービス	
PUBLIC BANK BERHAD	114	226	458	12,070	金融	
SIME DARBY BERHAD	94	397	377	9,933	資本財・サービス	
AXIATA GROUP BERHAD	180	183	87	2,296	電気通信サービス	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	17	37	92	2,421	生活必需品	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	103	234	167	4,395	素材	
GENTING MALAYSIA BHD	—	173	97	2,558	一般消費財・サービス	
IJM CORP BHD	112	—	—	—	資本財・サービス	
IOI CORP BHD	110	169	75	1,983	生活必需品	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	233	672	437	11,509	金融	
TENAGA NASIONAL BHD	169	364	513	13,503	公益事業	
PETRONAS GAS BHD	19	44	81	2,141	公益事業	
DIGI. COM BHD	124	269	134	3,538	電気通信サービス	
MAXIS BHD	85	—	—	—	電気通信サービス	
SAPURA ENERGY BHD	187	482	78	2,054	エネルギー	
マレーシア・リングギット通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,881 16銘柄	3,732 14銘柄	3,061	80,556 <2.5%>	
(南アフリカ)		百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
GOLD FIELDS LTD	89	173.6	795	6,807	素材	
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	48.8	147.9	1,012	8,669	一般消費財・サービス	
VODACOM GROUP LTD	18.2	55	911	7,804	電気通信サービス	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	23.3	36	713	6,109	生活必需品	
NEDBANK GROUP LTD	16.1	26.7	563	4,821	金融	
BIDVEST GROUP LTD	18.4	21.8	349	2,995	資本財・サービス	
BID CORP LTD	18.4	28.1	851	7,288	生活必需品	
NETCARE LTD	59.3	104.6	266	2,278	ヘルスケア	
STANDARD BANK GROUP LTD	99.1	162.2	2,368	20,278	金融	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	23.8	29.4	484	4,151	一般消費財・サービス	
SASOL LTD	43	100.7	3,771	32,281	素材	
REMGRO LTD	12.3	27.6	595	5,096	金融	
EXXARO RESOURCES LTD	—	23.9	229	1,966	エネルギー	
KUMBA IRON ORE LTD	—	16.5	288	2,468	素材	
PICK N PAY STORES LTD	—	37.7	222	1,904	生活必需品	

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	千南アフリカ・ランド	千円	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	18	37.2	265	2,276	一般消費財・サービス
SANLAM LTD	102.2	157	1,040	8,903	金融
TIGER BRANDS LTD	7.6	9.3	349	2,993	生活必需品
FIRSTRAND LTD	145.3	260.9	1,261	10,798	金融
AFRICAN PHOENIX INV LTD	147.34	—	—	—	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	29.7	70.2	441	3,776	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	11.7	16.8	235	2,017	一般消費財・サービス
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	27.3	69.9	1,009	8,641	金融
NASPERS LTD-N SHS	2.6	9.6	2,388	20,445	一般消費財・サービス
INVESTEC LTD	14	31	306	2,624	金融
MTN GROUP LTD	167	333.1	3,848	32,941	電気通信サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	75.8	120	442	3,785	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	4.9	12.2	354	3,033	ヘルスケア
HARMONY GOLD MINING CO LTD	33.1	—	—	—	素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	29	44	563	4,826	素材
BARLOWORLD LTD	27.7	39.1	435	3,729	資本財・サービス
SAPPI LIMITED	47.1	68.2	606	5,189	素材
TELKOM SA SOC LTD	26.8	40.9	258	2,212	電気通信サービス
MONDI LTD	—	8.4	288	2,470	素材
MMI HOLDINGS LTD	70.5	130.1	264	2,260	金融
NAMPAK LTD	76	—	—	—	素材
SPAR GROUP LIMITED/THE	10.9	19.4	301	2,584	生活必需品
MR PRICE GROUP LTD	8.3	15.9	248	2,130	一般消費財・サービス
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	39.6	96	242	2,072	ヘルスケア
SIBANYE GOLD LTD	32.5	147	222	1,906	素材
BRAIT SE	—	36.4	225	1,928	金融
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,624.64 36銘柄	2,764.3 38銘柄	29,026 <7.7%>	
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	26	58	1,125	3,735	金融
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	11	—	—	—	素材
SIAM CEMENT PCL-NVDR	—	21	1,062	3,527	素材
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	45	49	989	3,286	金融
KASIKORNBANK PCL-NVDR	—	32	636	2,114	金融
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	68	229	3,549	11,784	金融
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	—	140	651	2,161	金融
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	57	128	2,278	7,564	電気通信サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	183	773	1,445	4,799	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	—	615	1,008	3,348	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	137	226	1,966	6,527	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	773	1,788	956	3,175	エネルギー
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	—	231	773	2,569	エネルギー
PTT PCL-NVDR	103	246	9,200	30,545	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	68	161	1,211	4,022	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	86	228	1,442	4,787	生活必需品
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	112	189	978	3,247	電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	256	516	1,284	4,265	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	137	295	2,035	6,757	素材
タイ・パーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,062 14銘柄	5,925 18銘柄	32,596 <3.4%>	
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
PKO BANK POLSKI SA	56.6	90.7	312	9,484	金融
BANK PEKAO SA	7.2	20	247	7,510	金融
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	40.1	91.4	403	12,231	金融
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	101	162	104	3,176	エネルギー
PGE SA	65	140.9	168	5,116	公益事業
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	25.3	48.7	537	16,288	エネルギー
TAURON POLSKA ENERGIA SA	—	224.8	77	2,357	公益事業
ENERGA SA	—	74.3	76	2,308	公益事業
KGHM POLSKA MIEDZ SA	17.2	29.8	333	10,098	素材
ポーランド・ズロチ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	312.4 7銘柄	882.6 9銘柄	2,262 <2.1%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	88,683.32 337銘柄	183,546.11 346銘柄	— <91.8%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	柄	期首		当		期末	
		□ 数	□ 数	□ 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
POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT		57		75		1,499	169,535
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額	57		75		1,499	169,535
	銘柄数 < 比率 >	1 銘柄		1 銘柄			< 5.3% >
(メキシコ)			千口		千口	千メキシコ・ペソ	千円
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		6.7		22.5		770	4,794
メキシコ・ペソ通貨計	□ 数、金額	6.7		22.5		770	4,794
	銘柄数 < 比率 >	1 銘柄		1 銘柄			< 0.1% >
(南アフリカ)			千口		千口	南アフリカ・ランド	千円
REDEFINE PROPERTIES LTD		16.42		30.72		322	2,761
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		11.05		22.49		552	4,728
南アフリカ・ランド通貨計	□ 数、金額	27.47		53.21		874	7,489
	銘柄数 < 比率 >	2 銘柄		2 銘柄			< 0.2% >
合計	□ 数、金額	91.17		150.71		—	181,819
	銘柄数 < 比率 >	4 銘柄		4 銘柄			< 5.6% >

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

■投資信託財産の構成

2017年7月5日現在

項目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	2,964,260 千円	91.5 %
投資信託証券	181,819	5.6
コール・ローン等、その他	93,382	2.9
投資信託財産総額	3,239,461	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.08円、1香港ドル=14.48円、1台湾ドル=3.71円、1トルコ・リラ=31.79円、1メキシコ・ペソ=6.22円、100チリ・ペソ=17.04円、1インド・ルピー=1.76円、100インドネシア・ルピア=0.85円、1ブラジル・レアル=34.16円、1マレーシア・リンギット=26.31円、1南アフリカ・ランド=8.56円、1タイ・バーツ=3.32円、1ポーランド・ズロチ=30.31円です。
 (注3) 当期末における外貨建純資産(3,189,620千円)の投資信託財産総額(3,239,461千円)に対する比率は、98.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年7月5日現在

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

*期首における元本額は1,427,887,306円、当期中における追加設定元本額は1,873,531,273円、同解約元本額は1,065,233,711円です。
 *当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド(適格機関投資家専用)2,887,497円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)118,938,675円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)61,903,749円、D-1's 新興国株式インデックス48,973,624円、iFree 新興国株式インデックス613,728,793円、iFree 8資産バランス311,179,230円、DCダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド751,707,390円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式291,517,945円、ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド35,347,965円です。
 *当期末の計算口数当りの純資産額は14,435円です。

■損益の状況

当期 自2016年7月6日 至2017年7月5日

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

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

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

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

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2018年6月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ 日本債券インデックス」は、このたび、第2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/>

<4643>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数 (ベンチマーク)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
1 期末 (2017年 6月15日)	円 9,858	円 0	% △ 1.4	% 521.587	% △ 1.3	% 99.4	% —	百万円 14,248
2 期末 (2018年 6月15日)	円 9,915	円 0	% 0.6	% 525.468	% 0.7	% 99.4	% —	百万円 25,120

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

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

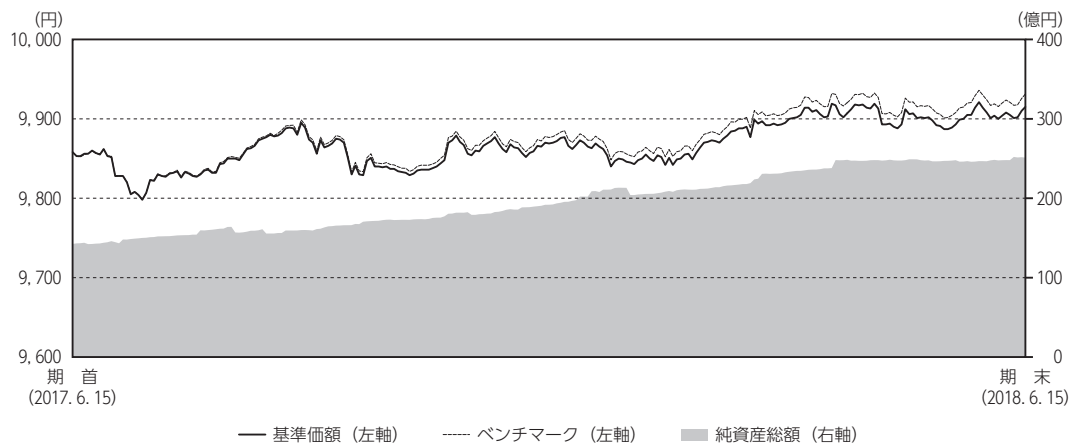
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注4) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

* ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数です。

■ 基準価額・騰落率

期 首 : 9,858円

期 末 : 9,915円

騰落率 : 0.6%

■ 基準価額の主な変動要因

債券からの利息収入がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (DB I) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%		%	%	%
(期首)2017年6月15日	9,858	—	521.587	—	99.4	—
6月末	9,828	△ 0.3	519.979	△ 0.3	99.5	—
7月末	9,828	△ 0.3	520.066	△ 0.3	98.6	—
8月末	9,879	0.2	522.848	0.2	99.6	—
9月末	9,841	△ 0.2	520.909	△ 0.1	99.0	—
10月末	9,840	△ 0.2	520.920	△ 0.1	99.2	—
11月末	9,864	0.1	522.295	0.1	99.3	—
12月末	9,869	0.1	522.656	0.2	99.4	—
2018年1月末	9,851	△ 0.1	521.766	0.0	99.4	—
2月末	9,888	0.3	523.788	0.4	99.4	—
3月末	9,902	0.4	524.618	0.6	99.3	—
4月末	9,893	0.4	524.225	0.5	99.6	—
5月末	9,914	0.6	525.397	0.7	99.1	—
(期末)2018年6月15日	9,915	0.6	525.468	0.7	99.4	—

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

国内債券市況

国内債券市場は、期を通してみると、長期金利はおおむね横ばいとなりました。期首より、欧州で政治リスクが後退したことなどから海外金利が上昇し、国内金利も上昇しました。2017年7月には、日銀が国債買い入れオペを増額したことや米国トランプ政権の政策実行能力への懸念が高まったことなどから、国内金利は低下しました。9月には、米国の2017年内追加利上げ観測の高まりなどを背景に海外金利が上昇したことを受けて、国内金利も上昇しましたが、11月には、日銀の金融緩和策の長期化観測などから長期金利は低下し、その後レンジ内での推移となりました。2018年1月に入ると、日銀の金融緩和策の縮小観測などから長期金利は上昇しました。2月以降は、政府が日銀の黒田総裁を再任する人事案を提示したことにより金融緩和の縮小観測が後退したことなどから、長期金利は低下しました。4月以降は、米国金利や原油価格の上昇などを背景に、長期金利は上昇しました。

前期における「今後の運用方針」

当ファンド

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

日本債券インデックスマザーファンド

今後も、ベンチマーク（ダイワ・ボンド・インデックス（DB I）総合指数）との高い連動性を維持するように運用を行ないます。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流出入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、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

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

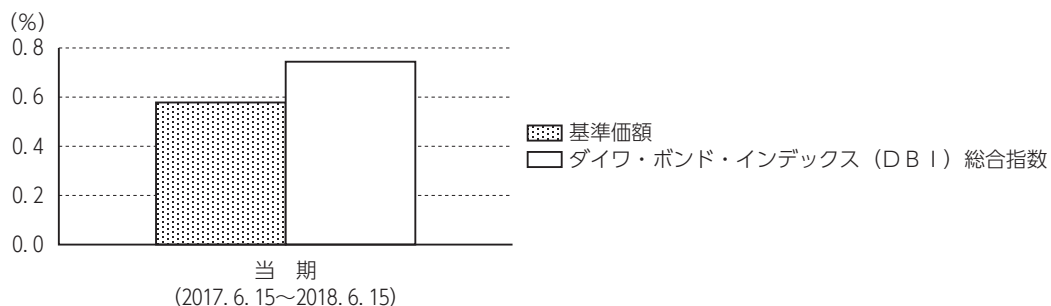
当ファンドの騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行ないました。期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッドの変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行ないました。

ベンチマークとの差異について

当期の当ファンドの基準価額の騰落率は0.6%となりました。一方、ベンチマークの騰落率は0.7%となりました。

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△0.2%程度でした。差異の内訳は、信託報酬要因によるベンチマークとの差異が△0.2%程度、「日本債券インデックスマザーファンド」におけるベンチマークとの差異が△0.0%程度となっており、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

なお、留保金につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳 (1万口当り)

項目	当 期	
	2017年6月16日 ~2018年6月15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)	48	

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

今後も、ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行ないます。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッドへの感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入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 (2017.6.16~2018.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	14円	0.146%	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9,868円です。
(投信会社)	(8)	(0.081)	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)	(5)	(0.054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(1)	(0.011)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 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
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用 (監査費用)	1 (1)	0.005 (0.005)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	15	0.151	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日本債券 インデックス マザーファンド	10,794,624	15,050,882	3,122,133	4,351,873

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	23,811	1,067	4.5	12,903	1,013	7.9
コール・ローン	79,246	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合28.3%

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

(3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
日本債券インデックス マザーファンド	10,226,323	17,898,814	25,095,927			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本債券インデックス マザーファンド	25,095,927	99.5
コール・ローン等、その他	138,327	0.5
投資信託財産総額	25,234,254	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

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	25,234,254,863円
コール・ローン等	75,541,259
日本債券インデックス マザーファンド(評価額)	25,095,927,810
未収入金	62,785,794
(B) 負債	113,324,812
未払解約金	96,116,755
未払信託報酬	16,592,742
その他未払費用	615,315
(C) 純資産総額(A-B)	25,120,930,051
元本	25,335,886,514
次期繰越損益金	△ 214,956,463
(D) 受益権総口数	25,335,886,514口
1万口当り基準価額(C/D)	9,915円

*期首における元本額は14,453,552,894円、当期中における追加設定元本額は17,894,969,975円、同解約元本額は7,012,636,355円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,915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214,956,463円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 24,423円
受取利息	3,469
支払利息	△ 27,892
(B) 有価証券売買損益	155,718,025
売買益	165,810,908
売買損	△ 10,092,883
(C) 信託報酬等	△ 29,714,705
(D) 当期損益金(A+B+C)	125,978,897
(E) 前期繰越損益金	△ 4,209,706
(F) 追加信託差損益金	△ 336,725,654
(配当等相当額)	(△) 17,270
(売買損益相当額)	(△) 336,708,384
(G) 合計(D+E+F)	△ 214,956,463
次期繰越損益金(G)	△ 214,956,463
追加信託差損益金	△ 336,725,654
(配当等相当額)	(△) 17,270
(売買損益相当額)	(△) 336,708,384
分配準備積立金	121,793,614
繰越損益金	△ 24,423

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

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

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	121,793,614
(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)	121,793,614
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	121,793,614
(h) 受益権総口数	25,335,886,514口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 日本債券インデックス）が投資対象としている「日本債券インデックスマザーファンド」の決算日（2017年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15日）現在における日本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145～150ページに併せて掲載いたしました。

■日本債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
350 10年国債 0.1% 2028/3/20	755,106	117 5年国債 0.2% 2019/3/20	732,722
347 10年国債 0.1% 2027/6/20	753,823	368 2年国債 0.1% 2018/9/15	631,617
135 5年国債 0.1% 2023/3/20	737,731	371 2年国債 0.1% 2018/12/15	531,527
349 10年国債 0.1% 2027/12/20	652,794	347 10年国債 0.1% 2027/6/20	503,049
348 10年国債 0.1% 2027/9/20	603,278	116 5年国債 0.2% 2018/12/20	501,870
132 5年国債 0.1% 2022/6/20	585,167	119 5年国債 0.1% 2019/6/20	481,214
130 5年国債 0.1% 2021/12/20	554,519	374 2年国債 0.1% 2019/3/15	320,867
383 2年国債 0.1% 2019/12/15	532,465	373 2年国債 0.1% 2019/2/15	300,751
134 5年国債 0.1% 2022/12/20	515,168	300 10年国債 1.5% 2019/3/20	290,987
385 2年国債 0.1% 2020/2/15	502,650	118 5年国債 0.2% 2019/6/20	270,966

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年6月15日現在における日本債券インデックスマザーファンド（53,122,088千円）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）

作 成 期	2018年6月15日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 比	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	57,516,000	62,694,390	84.2	—	56.5	20.3	7.3
地方債証券	4,250,000	4,460,002	6.0	—	2.7	2.6	0.6
特殊債券（除く金融債券）	3,100,000	3,240,168	4.4	—	1.9	2.5	—
金融債券	100,000	98,205	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	3,500,000	3,606,957	4.8	—	1.8	1.8	1.2
合 計	68,466,000	74,099,724	99.5	—	63.1	27.3	9.1

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

区 分	2018年6月15日現在				
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国債証券	378 2年国債	0.1000	100,000	100,258	2019/07/15
	380 2年国債	0.1000	330,000	330,986	2019/09/15
	120 5年国債	0.2000	180,000	180,770	2019/09/20
	121 5年国債	0.1000	550,000	551,661	2019/09/20
	303 10年国債	1.4000	60,000	61,164	2019/09/20
	304 10年国債	1.3000	110,000	111,995	2019/09/20
	43 20年国債	2.9000	100,000	103,829	2019/09/20
	382 2年国債	0.1000	250,000	250,847	2019/11/15
	383 2年国債	0.1000	530,000	531,902	2019/12/15
	122 5年国債	0.1000	630,000	632,230	2019/12/20
	305 10年国債	1.3000	500,000	510,830	2019/12/20
	385 2年国債	0.1000	500,000	502,000	2020/02/15
	123 5年国債	0.1000	730,000	732,949	2020/03/20
	306 10年国債	1.4000	255,000	261,877	2020/03/20
	307 10年国債	1.3000	400,000	410,088	2020/03/20
	44 20年国債	2.5000	85,000	88,936	2020/03/20
	45 20年国債	2.4000	78,000	81,474	2020/03/20
	124 5年国債	0.1000	980,000	984,527	2020/06/20
	308 10年国債	1.3000	200,000	205,770	2020/06/20
	309 10年国債	1.1000	90,000	92,234	2020/06/20
46 20年国債	2.2000	73,000	76,436	2020/06/22	

2018年6月15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	
	125 5年国債	0.1000	860,000	864,472	2020/09/20
	310 10年国債	1.0000	130,000	133,341	2020/09/20
	311 10年国債	0.8000	150,000	153,175	2020/09/20
	47 20年国債	2.2000	89,000	93,700	2020/09/21
	126 5年国債	0.1000	890,000	895,144	2020/12/20
	312 10年国債	1.2000	395,000	408,264	2020/12/20
	48 20年国債	2.5000	54,000	57,575	2020/12/21
	127 5年国債	0.1000	780,000	784,953	2021/03/20
	313 10年国債	1.3000	200,000	207,902	2021/03/20
	314 10年国債	1.1000	260,000	268,834	2021/03/20
	49 20年国債	2.1000	64,000	67,960	2021/03/22
	50 20年国債	1.9000	107,000	113,029	2021/03/22
	128 5年国債	0.1000	755,000	760,118	2021/06/20
	315 10年国債	1.2000	221,000	229,833	2021/06/20
	316 10年国債	1.1000	250,000	259,237	2021/06/20
	51 20年国債	2.0000	82,000	87,274	2021/06/21
	129 5年国債	0.1000	880,000	886,327	2021/09/20
	317 10年国債	1.1000	214,000	222,536	2021/09/20
	318 10年国債	1.0000	200,000	207,324	2021/09/20
	52 20年国債	2.1000	52,000	55,787	2021/09/21
	130 5年国債	0.1000	980,000	987,585	2021/12/20
	319 10年国債	1.1000	100,000	104,278	2021/12/20
	320 10年国債	1.0000	230,000	239,027	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	66,000	71,147	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	65,000	70,298	2021/12/20
	131 5年国債	0.1000	920,000	927,626	2022/03/20
	321 10年国債	1.0000	175,000	182,355	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	130,000	134,973	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	140,000	151,169	2022/03/21
	132 5年国債	0.1000	580,000	585,133	2022/06/20
	324 10年国債	0.8000	410,000	425,092	2022/06/20
	133 5年国債	0.1000	250,000	252,352	2022/09/20
	325 10年国債	0.8000	310,000	322,133	2022/09/20
	58 20年国債	1.9000	200,000	217,194	2022/09/20
	134 5年国債	0.1000	510,000	515,079	2022/12/20
	326 10年国債	0.7000	30,000	31,107	2022/12/20
	327 10年国債	0.8000	450,000	468,652	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	48,689	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,683	2022/12/20
	135 5年国債	0.1000	600,000	606,162	2023/03/20
	328 10年国債	0.6000	550,000	568,656	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	105,304	2023/03/20
	329 10年国債	0.8000	500,000	522,765	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	99,325	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	142,460	2023/06/20
	330 10年国債	0.8000	312,000	326,838	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	365,000	378,501	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	99,486	2023/09/20
	332 10年国債	0.6000	310,000	321,835	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	194,272	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	135,000	149,119	2023/12/20
	333 10年国債	0.6000	640,000	665,344	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	61,294	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	135,813	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	123,860	2024/03/20
	334 10年国債	0.6000	600,000	624,618	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	95,420	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	142,197	2024/06/20
	335 10年国債	0.5000	780,000	808,197	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	175,000	198,929	2024/09/20
	336 10年国債	0.5000	275,000	285,243	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	300,000	307,254	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	136,236	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	83,354	2024/12/20
	338 10年国債	0.4000	490,000	505,454	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	91,748	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	57,797	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	148,209	2025/03/20
	339 10年国債	0.4000	380,000	392,156	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	69,386	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	57,225	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	61,032	2025/06/20
	340 10年国債	0.4000	770,000	795,525	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	76,000	87,348	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	100,624	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	520,000	533,712	2025/12/20

2018年6月15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	
	83 20年国債	2.1000	93,000	108,025	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	780,000	788,798	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	67,679	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	94,596	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	64,606	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	800,000	808,664	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	118,745	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	91,994	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	640,000	646,617	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	23,682	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	60,000	71,542	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	590,000	595,776	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	365,843	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	750,000	756,892	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	117,558	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	153,964	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	250,000	252,137	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	60,329	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	65,371	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	600,000	604,992	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	48,102	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	120,000	143,196	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	650,000	654,933	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	250,000	299,340	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	650,000	654,420	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	187,709	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	75,000	92,286	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	99,662	2028/04/20
	102 20年国債	2.4000	80,000	98,814	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	70,000	85,765	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	12,052	2028/06/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	152,359	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	182,911	2028/09/20
	107 20年国債	2.1000	27,000	32,750	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	177,000	211,003	2028/12/20
	109 20年国債	1.9000	35,000	41,813	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	130,000	158,081	2029/03/20
	111 20年国債	2.2000	130,000	159,978	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	170,000	207,349	2029/06/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	20,843	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	250,000	305,830	2029/09/20
	114 20年国債	2.1000	130,000	159,576	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	223,000	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	30,336	2030/02/20
	116 20年国債	2.2000	140,000	173,951	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	215,000	264,643	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	37,686	2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	116,136	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	111,490	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	210,000	246,781	2030/06/20
	121 20年国債	1.9000	135,000	163,829	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	160,000	192,238	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	48,163	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	140,000	173,727	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	193,000	237,123	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	85,000	106,872	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	135,465	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	165,000	201,133	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	35,230	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	119,000	145,379	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	200,000	241,788	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	169,586	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	80,000	95,868	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	31,004	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	120,000	144,051	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	210,000	254,858	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	80,000	97,263	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	110,618	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	185,000	219,961	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	70,690	2032/05/20
	137 20年国債	1.7000	70,000	84,247	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	87,000	102,338	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	185,000	220,135	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	335,000	403,815	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	32,966	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	50,097	2032/12/20

2018年6月15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	
	141 20年国債	1.7000	170,000	205,225	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	200,000	244,422	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	50,478	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	250,693	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	120,000	141,543	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	48,423	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	320,000	387,385	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	76,257	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	230,000	278,603	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	94,311	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	250,000	299,487	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	108,310	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	300,000	354,951	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	100,000	133,905	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	252,000	298,410	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	100,000	134,207	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	320,000	373,984	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	80,000	106,339	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	300,000	341,124	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	105,270	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	350,000	398,023	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	75,140	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	380,000	438,292	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	60,000	81,192	2035/09/20
	154 20年国債	1.2000	330,000	375,038	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	79,300	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	240,000	264,640	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	70,000	95,155	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	330,000	329,726	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	60,000	81,711	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	360,000	346,449	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	125,512	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	100,000	101,270	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	199,452	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	230,000	236,499	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	242,800	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	220,000	229,708	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	290,000	297,093	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	205,770	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	300,000	306,615	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	290,000	295,942	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	233,857	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	310,000	310,000	2038/03/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	272,404	2038/09/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	296,406	2039/03/20
	31 30年国債	2.2000	180,000	239,718	2039/09/20
	32 30年国債	2.3000	235,000	318,927	2040/03/20
	33 30年国債	2.0000	261,000	339,070	2040/09/20
	34 30年国債	2.2000	233,000	313,280	2041/03/20
	35 30年国債	2.0000	270,000	352,177	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	270,000	352,989	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	290,000	373,786	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	170,000	215,826	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	172,000	222,552	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	140,000	178,019	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	170,000	212,306	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	146,000	182,434	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	160,000	200,041	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	165,000	206,405	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	200,000	240,614	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	180,000	216,595	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	190,000	233,612	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	190,000	224,293	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	93,000	109,787	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	215,000	221,280	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	210,000	189,222	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	235,000	223,383	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	195,000	190,138	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	218,000	223,753	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	200,000	205,068	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	210,000	215,098	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	200,000	204,640	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	101,553	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	220,000	224,862	2048/03/20
	2 40年国債	2.2000	116,000	162,917	2049/03/20
	3 40年国債	2.2000	74,000	104,464	2050/03/20

2018年6月15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	
	4 40年国債	2.2000	107,000	151,581	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	170,296	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	140,220	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	154,496	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	272,287	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	189,002	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	375,000	381,577	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	60,000	58,846	2058/03/20
種別小計	銘柄数 金 額	257銘柄	57,516,000	62,694,390	
地方債証券					
	76 共同発行地方	1.4000	50,000	50,769	2019/07/25
	21-6 千葉県公債	1.4100	100,000	101,787	2019/09/25
	81 共同発行地方	1.3200	100,000	101,994	2019/12/25
	21-3 広島市公債	1.3400	100,000	102,025	2019/12/25
	21-5 京都市公債	1.4500	100,000	102,445	2020/02/25
	471 名古屋市債	1.2700	100,000	102,527	2020/06/19
	688 東京都公債	0.9400	100,000	102,110	2020/09/18
	90 共同発行地方	1.1200	100,000	102,529	2020/09/25
	22-1 岡山県公債	1.0500	100,000	102,560	2020/11/30
	22-5 京都府公債	1.2600	100,000	103,151	2020/12/21
	699 東京都公債	1.0200	100,000	103,238	2021/09/17
	23-2 島根県公債	1.0300	100,000	103,452	2021/11/25
	108 共同発行地方	1.0100	100,000	103,699	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	103,670	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	103,211	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	103,549	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	103,363	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	103,183	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	103,370	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	103,332	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	103,123	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	103,163	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	103,345	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	102,053	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	104,001	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	206,907	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	103,390	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	102,783	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,329	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	206,083	2025/04/16
	751 東京都公債	0.3700	100,000	102,020	2025/12/19
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	199,813	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,312	2027/06/23
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	121,577	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	118,713	2028/12/20
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	120,080	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	116,754	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	116,743	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	108,101	2035/12/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	112,731	2045/12/20
種別小計	銘柄数 金 額	40銘柄	4,250,000	4,460,002	
特殊債券 (除く金融債券)					
	14政保地方公共6	0.1990	100,000	100,417	2020/06/18
	61 道路機構	1.2400	100,000	102,448	2020/06/19
	13 地方公共団体	1.2780	100,000	102,548	2020/06/26
	110 政保道路機構	1.3000	100,000	102,665	2020/06/30
	3 公営企業15年	2.2000	100,000	106,456	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	103,304	2021/10/28
	81 道路機構	1.0300	100,000	103,456	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	103,659	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	103,679	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	103,478	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	103,368	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	103,547	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	103,499	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	103,833	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	103,172	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	103,170	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	103,680	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	103,009	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	103,965	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,694	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,889	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,295	2025/04/28

2018年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	261 政保道路機構	0.3810 %	200,000	204,965	2025/11/28
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	110,546	2027/08/25
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	110,747	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	119,982	2029/07/31
	31 地方公共団20	1.7440	100,000	118,917	2033/09/28
	223 政保道路機構	1.4270	100,000	116,248	2034/07/31
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	188,520	2036/07/31
種別小計	銘 柄 数	29銘柄			
	金 額		3,100,000	3,240,168	
金融債券	19 利付商工債	0.1000	100,000	98,205	2026/09/18
種別小計	銘 柄 数	1銘柄			
	金 額		100,000	98,205	
普通社債券	14 武田薬品	0.5400	100,000	100,502	2019/07/19
	20 三井住友 BK 劣	2.2100	100,000	102,388	2019/07/24
	164 オリックス	1.1460	100,000	101,250	2019/08/07
	24 太平洋セメント	0.3900	100,000	100,310	2019/09/11
	423 九州電力	0.9590	100,000	101,207	2019/09/25
	62東日本旅客鉄道	1.4240	100,000	101,786	2019/09/27
	8ドイツ銀行 AG ロンドン	0.4700	100,000	99,705	2019/11/14
	29 東日本高速道	0.1800	100,000	100,268	2020/03/19
	260 北陸電力	2.3300	100,000	104,505	2020/05/25
	9 AUST・NZ 銀行	0.3430	100,000	100,401	2020/07/24
	20 東京三菱銀行	2.5700	100,000	105,395	2020/07/27
	15 トヨタファイナンス	1.8000	100,000	103,866	2020/08/21
	17 シティグループ・インク	2.0400	100,000	104,287	2020/09/16
	72東日本旅客鉄道	1.2800	100,000	103,111	2020/12/22
	44 野村ホールディング	0.7230	100,000	101,543	2021/02/25
	2 イオン FS	0.5720	100,000	100,532	2021/03/18
	9三菱 UFJ 信託 BK 劣	1.6800	100,000	104,462	2021/04/28
	11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,699	2022/06/20
	11三菱 UFJ 信託 BK	1.3600	100,000	104,741	2022/06/27
	372 中国電力	1.2040	100,000	104,681	2022/08/25
	4 JX ホールディングス	1.1450	100,000	104,511	2022/12/14
	30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	103,034	2022/12/14
	175 オリックス	1.0640	100,000	104,360	2023/11/24
	21 西日本高速道	0.7540	100,000	103,433	2023/12/20
	1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	103,400	2024/06/26
	5 野村不動産 HD	0.9240	100,000	103,748	2025/05/30
	4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	103,671	2025/12/18
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,283	2026/08/21
	17 パナソニック	0.4700	100,000	101,101	2026/09/18
	509 関西電力	0.4700	100,000	100,654	2027/05/25
	12 アサヒグループ HD	0.3300	100,000	100,279	2027/06/11
	15 デンソー	0.2450	100,000	99,852	2027/06/18
	78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	99,935	2027/07/23
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	119,634	2029/01/29
	107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	113,408	2045/01/27
種別小計	銘 柄 数	35銘柄			
	金 額		3,500,000	3,606,957	
合 計	銘 柄 数	362銘柄			
	金 額		68,466,000	74,099,724	

(注) 単位未満は切捨て。

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第18期 (決算日 2017年11月30日)

(計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

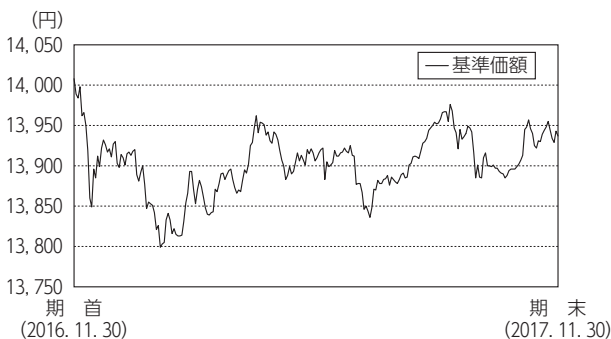
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年月日	基準価額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数 (ベンチマーク)		公社債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率 %	円	騰落率 %	%	%
(期首) 2016年11月30日	14,008	—	524.807	—	98.5	—
12月末	13,930	△ 0.6	521.909	△ 0.6	99.3	—
2017年1月末	13,851	△ 1.1	518.958	△ 1.1	99.3	—
2月末	13,893	△ 0.8	520.564	△ 0.8	99.2	—
3月末	13,873	△ 1.0	519.891	△ 0.9	98.1	—
4月末	13,942	△ 0.5	522.469	△ 0.4	99.6	—
5月末	13,916	△ 0.7	521.440	△ 0.6	99.0	—
6月末	13,877	△ 0.9	519.979	△ 0.9	99.6	—
7月末	13,880	△ 0.9	520.066	△ 0.9	98.7	—
8月末	13,953	△ 0.4	522.848	△ 0.4	99.7	—
9月末	13,901	△ 0.8	520.909	△ 0.7	99.1	—
10月末	13,902	△ 0.8	520.920	△ 0.7	99.3	—
(期末) 2017年11月30日	13,937	△ 0.5	522.295	△ 0.5	99.4	—

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：14,008円 期末：13,937円 騰落率：△0.5%

【基準価額の主な変動要因】

債券からの利息収入を得た一方、金利水準の上昇による債券価格の下落により、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内債券市況

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

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

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

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。
 (注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
 (注3) 社債券には新株予約権付社債券(転換社債券)は含まれておりません。
 (注4) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

公 社 債

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
131 5年国債 0.1% 2022/3/20	1,010,475	368 2年国債 0.1% 2018/9/15	631,617
346 10年国債 0.1% 2027/3/20	844,805	366 2年国債 0.1% 2018/7/15	441,690
130 5年国債 0.1% 2021/12/20	707,309	371 2年国債 0.1% 2018/12/15	381,227
324 10年国債 0.8% 2022/6/20	586,156	127 5年国債 0.1% 2021/3/20	262,350
371 2年国債 0.1% 2018/12/15	583,765	341 10年国債 0.3% 2025/12/20	256,429
347 10年国債 0.1% 2027/6/20	572,679	131 5年国債 0.1% 2022/3/20	252,170
345 10年国債 0.1% 2026/12/20	571,739	293 10年国債 1.8% 2018/6/20	242,905
129 5年国債 0.1% 2021/9/20	504,938	160 20年国債 0.7% 2037/3/20	231,899
121 5年国債 0.1% 2019/9/20	502,884	64 政保道路機構 1.6% 2018/8/29	222,882
160 20年国債 0.7% 2037/3/20	454,931	332 10年国債 0.6% 2023/12/20	209,246

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

■ 組入資産明細表

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

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		
					5年以上	2年以上	2年未満
千円	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	52,073,000	56,883,147	83.5	—	54.9	19.7	8.9
地方債証券	4,250,000	4,405,150	6.5	—	2.9	2.7	0.8
特殊債券(除く金融債券)	3,000,000	3,112,472	4.6	—	2.4	2.0	0.1
金融債券	100,000	98,784	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	3,100,000	3,212,890	4.7	—	1.2	2.0	1.5
合 計	62,523,000	67,712,446	99.4	—	61.6	26.3	11.4

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

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

区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	当 期		償還年月日
				評 価 額	金 額	
千円	千円	%	千円	千円		
国債証券	371 2年国債	0.1000	200,000	200,546		2018/12/15
	116 5年国債	0.2000	500,000	501,880		2018/12/20
	297 10年国債	1.4000	70,000	71,141		2018/12/20
	298 10年国債	1.3000	125,000	126,907		2018/12/20
	372 2年国債	0.1000	130,000	130,384		2019/01/15
	373 2年国債	0.1000	300,000	300,954		2019/02/15
	374 2年国債	0.1000	320,000	321,084		2019/03/15
	117 5年国債	0.2000	730,000	733,299		2019/03/20
	299 10年国債	1.3000	250,000	254,685		2019/03/20
	300 10年国債	1.5000	286,000	292,100		2019/03/20
	41 20年国債	1.5000	136,000	138,909		2019/03/20
	42 20年国債	2.6000	87,000	90,092		2019/03/20
	375 2年国債	0.1000	60,000	60,216		2019/04/15
	376 2年国債	0.1000	250,000	250,957		2019/05/15

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率 %	末		償還年月日
			額 面 金 額 千円	評 価 額 千円	
	377 2年国債	0.1000	150,000	150,609	2019/06/15
	118 5年国債	0.2000	270,000	271,460	2019/06/20
	119 5年国債	0.1000	480,000	481,852	2019/06/20
	301 10年国債	1.5000	120,000	123,060	2019/06/20
	302 10年国債	1.4000	240,000	245,750	2019/06/20
	380 2年国債	0.1000	330,000	331,560	2019/09/15
	120 5年国債	0.2000	180,000	181,132	2019/09/20
	121 5年国債	0.1000	550,000	552,469	2019/09/20
	303 10年国債	1.4000	60,000	61,673	2019/09/20
	304 10年国債	1.3000	110,000	112,869	2019/09/20
	43 20年国債	2.9000	100,000	105,488	2019/09/20
	122 5年国債	0.1000	630,000	633,162	2019/12/20
	305 10年国債	1.3000	500,000	514,810	2019/12/20
	123 5年国債	0.1000	580,000	583,265	2020/03/20
	306 10年国債	1.4000	255,000	264,021	2020/03/20
	307 10年国債	1.3000	400,000	413,232	2020/03/20
	44 20年国債	2.5000	85,000	90,156	2020/03/20
	45 20年国債	2.4000	78,000	82,552	2020/03/20
	124 5年国債	0.1000	550,000	553,366	2020/06/20
	308 10年国債	1.3000	200,000	207,322	2020/06/20
	309 10年国債	1.1000	90,000	92,835	2020/06/20
	46 20年国債	2.2000	73,000	77,357	2020/06/22
	125 5年国債	0.1000	640,000	644,396	2020/09/20
	310 10年国債	1.0000	130,000	134,119	2020/09/20
	311 10年国債	0.8000	150,000	153,912	2020/09/20
	47 20年国債	2.2000	89,000	94,821	2020/09/21
	126 5年国債	0.1000	750,000	755,385	2020/12/20
	312 10年国債	1.2000	395,000	411,052	2020/12/20
	48 20年国債	2.5000	54,000	58,352	2020/12/21
	127 5年国債	0.1000	680,000	685,276	2021/03/20
	313 10年国債	1.3000	200,000	209,450	2021/03/20
	314 10年国債	1.1000	260,000	270,566	2021/03/20
	49 20年国債	2.1000	64,000	68,735	2021/03/22
	50 20年国債	1.9000	107,000	114,208	2021/03/22
	128 5年国債	0.1000	605,000	609,948	2021/06/20
	315 10年国債	1.2000	221,000	231,417	2021/06/20
	316 10年国債	1.1000	250,000	260,895	2021/06/20
	51 20年国債	2.0000	82,000	88,204	2021/06/21
	129 5年国債	0.1000	830,000	837,279	2021/09/20
	317 10年国債	1.1000	214,000	223,993	2021/09/20
	318 10年国債	1.0000	200,000	208,578	2021/09/20
	52 20年国債	2.1000	52,000	56,414	2021/09/21
	130 5年国債	0.1000	700,000	706,538	2021/12/20
	319 10年国債	1.1000	100,000	104,957	2021/12/20
	320 10年国債	1.0000	230,000	240,467	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	66,000	71,953	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	65,000	71,127	2021/12/20
	131 5年国債	0.1000	750,000	757,275	2022/03/20
	321 10年国債	1.0000	175,000	183,491	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	130,000	135,747	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	140,000	152,807	2022/03/21
	132 5年国債	0.1000	310,000	313,112	2022/06/20
	324 10年国債	0.8000	410,000	427,129	2022/06/20
	56 20年国債	2.0000	70,000	76,759	2022/06/20
	133 5年国債	0.1000	200,000	202,120	2022/09/20
	325 10年国債	0.8000	310,000	323,596	2022/09/20
	327 10年国債	0.8000	300,000	313,764	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	49,118	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,763	2022/12/20
	328 10年国債	0.6000	330,000	342,282	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	105,878	2023/03/20
	329 10年国債	0.8000	355,000	372,700	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	99,765	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	143,765	2023/06/20
	330 10年国債	0.8000	262,000	275,582	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	265,000	275,650	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	100,431	2023/09/20
	332 10年国債	0.6000	310,000	322,899	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	196,101	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	135,000	150,458	2023/12/20
	333 10年国債	0.6000	540,000	563,214	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	61,884	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	137,296	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	125,160	2024/03/20
	334 10年国債	0.6000	600,000	626,622	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	96,505	2024/06/20

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率 %	末		償還年月日
			額 面 金 額 千円	評 価 額 千円	
	71 20年国債	2.2000	125,000	143,696	2024/06/20
	335 10年国債	0.5000	630,000	654,733	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	175,000	200,924	2024/09/20
	336 10年国債	0.5000	175,000	182,124	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	300,000	307,857	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	137,534	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	84,183	2024/12/20
	338 10年国債	0.4000	390,000	403,283	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	92,619	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	58,298	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	149,554	2025/03/20
	339 10年国債	0.4000	440,000	454,986	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	69,979	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	57,738	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	61,603	2025/06/20
	340 10年国債	0.4000	680,000	703,392	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	76,000	88,087	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	101,516	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	420,000	431,172	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	108,928	2025/12/20
	84 20年国債	2.0000	100,000	116,321	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	700,000	707,266	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	68,182	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	95,372	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	65,112	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	700,000	706,881	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	119,749	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	92,737	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	540,000	544,984	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	120,000	143,216	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	60,000	72,136	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	550,000	554,719	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	280,000	332,724	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	750,000	755,910	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	118,360	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	155,074	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	570,000	574,337	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	60,799	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	155,000	185,528	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	180,000	181,229	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	48,452	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	120,000	144,187	2027/09/20
	99 20年国債	2.1000	200,000	241,214	2027/12/20
	100 20年国債	2.2000	55,000	67,106	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	75,000	93,043	2028/03/20
	102 20年国債	2.4000	80,000	99,559	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	70,000	86,381	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	110,000	133,437	2028/06/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	153,320	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	184,131	2028/09/20
	107 20年国債	2.1000	107,000	130,589	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	177,000	212,031	2028/12/20
	109 20年国債	1.9000	35,000	42,056	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	130,000	159,116	2029/03/20
	111 20年国債	2.2000	100,000	123,891	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	170,000	208,676	2029/06/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	20,986	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	230,000	282,962	2029/09/20
	114 20年国債	2.1000	130,000	160,368	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	160,000	199,273	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	30,531	2030/02/20
	116 20年国債	2.2000	89,000	111,151	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	215,000	265,914	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	37,887	2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	116,564	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	111,752	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	210,000	247,180	2030/06/20
	121 20年国債	1.9000	135,000	164,245	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	160,000	192,657	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	48,463	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	140,000	174,256	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	143,000	176,168	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	85,000	107,146	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	70,000	86,368	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	165,000	201,443	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	35,361	2031/05/20

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率 %	末		
			額 面 金 額 千円	評 価 額 千円	償還年月日
	128 20年国債	1.9000	119,000	145,577	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	160,000	193,625	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	169,727	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	130,000	155,758	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	31,086	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	120,000	143,997	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	210,000	254,851	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	50,000	60,776	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	110,481	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	155,000	183,997	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	70,830	2032/05/20
	137 20年国債	1.7000	85,000	102,222	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	87,000	102,116	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	125,000	148,575	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	335,000	403,437	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	32,942	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	49,952	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	170,000	204,846	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	150,000	183,045	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	50,262	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	250,275	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	120,000	141,154	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	48,316	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	285,000	343,995	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	76,171	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	275,000	332,304	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	94,155	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	170,000	202,896	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	108,240	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	245,000	288,644	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	100,000	133,829	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	232,000	273,291	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	100,000	133,997	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	250,000	290,485	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	80,000	106,121	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	300,000	338,562	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	104,835	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	280,000	315,714	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	74,813	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	315,000	360,290	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	60,000	80,863	2035/09/20
	154 20年国債	1.2000	300,000	337,902	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	78,919	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	240,000	261,808	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	70,000	94,650	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	273,000	268,874	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	60,000	81,189	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	323,000	305,777	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	124,682	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	153,000	152,605	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	197,980	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	230,000	232,985	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	150,000	200,847	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	220,000	226,347	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	250,000	251,982	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	204,219	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	200,000	201,246	2037/09/20
	28 30年国債	2.5000	150,000	204,886	2038/03/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	270,050	2038/09/20
	30 30年国債	2.3000	177,000	236,257	2039/03/20
	31 30年国債	2.2000	165,000	217,560	2039/09/20
	32 30年国債	2.3000	200,000	268,430	2040/03/20
	33 30年国債	2.0000	261,000	334,604	2040/09/20
	34 30年国債	2.2000	213,000	282,640	2041/03/20
	35 30年国債	2.0000	250,000	321,535	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	226,000	291,225	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	290,000	367,795	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	159,000	198,284	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	152,000	193,196	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	140,000	174,792	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	140,000	171,593	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	146,000	179,013	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	160,000	196,252	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	140,000	171,781	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	168,000	198,110	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	180,000	212,508	2045/03/20

区 分	当 期		末		償還年月日
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	
		%	千円	千円	
	47 30年国債	1.6000	167,000	201,240	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	190,000	219,413	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	173,000	199,749	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	185,000	185,212	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	190,000	165,805	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	205,000	189,057	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	195,000	184,719	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	188,000	187,332	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	190,000	189,319	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	130,000	129,377	2047/09/20
	1 40年国債	2.4000	85,000	120,660	2048/03/20
	2 40年国債	2.2000	116,000	159,029	2049/03/20
	3 40年国債	2.2000	74,000	101,892	2050/03/20
	4 40年国債	2.2000	107,000	147,740	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	165,585	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	136,223	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	149,732	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	150,000	171,418	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	258,000	211,621	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	165,000	160,571	2057/03/20
種別小計	銘柄数	262銘柄			
	金額		52,073,000	56,883,147	
地方債証券	665 東京都公債	1.4300	100,000	101,485	2018/12/20
	21-2 千葉県公債	1.5700	100,000	102,270	2019/05/24
	163 神奈川県公債	1.4000	100,000	102,120	2019/06/20
	21-3 埼玉県公債	1.6400	100,000	102,510	2019/06/25
	76 共同発行地方	1.4000	50,000	51,125	2019/07/25
	21-6 千葉県公債	1.4100	100,000	102,498	2019/09/25
	81 共同発行地方	1.3200	100,000	102,655	2019/12/25
	21-3 広島市公債	1.3400	100,000	102,697	2019/12/25
	21-5 京都市公債	1.4500	100,000	103,156	2020/02/25
	471 名古屋市債	1.2700	100,000	103,134	2020/06/19
	688 東京都公債	0.9400	100,000	102,512	2020/09/18
	90 共同発行地方	1.1200	100,000	103,018	2020/09/25
	22-1 岡山県公債	1.0500	100,000	103,017	2020/11/30
	22-5 京都府公債	1.2600	100,000	103,716	2020/12/21
	699 東京都公債	1.0200	100,000	103,758	2021/09/17
	23-2 島根県公債	1.0300	100,000	103,941	2021/11/25
	108 共同発行地方	1.0100	100,000	104,175	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	104,123	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	103,585	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	103,955	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	103,695	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	103,481	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	103,701	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	103,628	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	103,391	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	103,431	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	103,633	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	102,115	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	104,299	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	207,313	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	103,608	2024/02/23
26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	102,982	2024/11/25	
26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,573	2025/02/26	
3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	206,608	2025/04/16	
751 東京都公債	0.3700	100,000	102,001	2025/12/19	
420 大阪府公債	0.1700	200,000	199,496	2027/05/28	
29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,122	2027/06/23	
19 兵庫県公債20年	1.5700	100,000	116,231	2033/12/09	
16 千葉県20年	1.5550	100,000	116,411	2034/04/14	
31 神奈川県20年	1.0020	100,000	106,966	2035/12/20	
種別小計	銘柄数	40銘柄			
	金額		4,250,000	4,405,150	
特殊債券 (除く金融債券)	24 政保中日本道	1.3000	100,000	101,483	2019/01/22
	14 政保地方公共6	0.1990	100,000	100,468	2020/06/18
	61 道路機構	1.2400	100,000	103,015	2020/06/19
	13 地方公共団体	1.2780	100,000	103,153	2020/06/26
	110 政保道路機構	1.3000	100,000	103,313	2020/06/30
	3 公営企業15年	2.2000	100,000	107,589	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	103,792	2021/10/28
	81 道路機構	1.0300	100,000	103,789	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	104,147	2022/02/28

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当 期		末		償還年月日
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	
		%	千円	千円	
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	104,006	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	103,865	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	103,721	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	103,900	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	103,840	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	104,181	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	103,435	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	103,449	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	103,982	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	103,191	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	104,313	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,941	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	102,021	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,562	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	204,847	2025/11/28
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	110,958	2027/08/25
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	111,039	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	120,509	2029/07/31
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	184,952	2036/07/31
種別小計	銘 柄 数	28銘柄			
	金 額		3,000,000	3,112,472	
金融債券	19 利付商工債	0.1000	100,000	98,784	2026/09/18
種別小計	銘 柄 数	1銘柄			
	金 額		100,000	98,784	
普通社債券	18 西日本旅客鉄	1.7000	100,000	101,725	2018/12/11
	4 リソな銀行劣後	2.7660	100,000	104,117	2019/06/20
	46 NTT ファイナンス	0.2500	100,000	100,333	2019/06/20
	14 武田薬品	0.5400	100,000	100,783	2019/07/19
	20 三井住友 BK 劣	2.2100	100,000	103,487	2019/07/24
	164 オリックス	1.1460	100,000	101,821	2019/08/07
	24 太平洋セメント	0.3900	100,000	100,442	2019/09/11
	423 九州電力	0.9590	100,000	101,650	2019/09/25
	62東日本旅客鉄道	1.4240	100,000	102,529	2019/09/27
	8ドイツ銀行 AG ロンドン	0.4700	100,000	100,217	2019/11/14
	29 東日本高速道	0.1800	100,000	100,257	2020/03/19
	260 北陸電力	2.3300	100,000	105,627	2020/05/25
	9 AUST・NZ 銀行	0.3430	100,000	100,392	2020/07/24
	20 東京三菱銀行	2.5700	100,000	106,723	2020/07/27
	15 トヨタファイナンス	1.8000	100,000	104,724	2020/08/21
	17 シティグループ・インク	2.0400	100,000	105,128	2020/09/16
	72東日本旅客鉄道	1.2800	100,000	103,695	2020/12/22
	44 野村ホールディング	0.7230	100,000	101,656	2021/02/25
	2 イオンFS	0.5720	100,000	100,638	2021/03/18
	9三菱UFJ信託BK劣	1.6800	100,000	105,128	2021/04/28
	11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,830	2022/06/20
	11三菱UFJ信託BK	1.3600	100,000	105,283	2022/06/27
	372 中国電力	1.2040	100,000	104,967	2022/08/25
	4 JX ホールディングス	1.1450	100,000	104,842	2022/12/14
	30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	103,214	2022/12/14
	175 オリックス	1.0640	100,000	104,500	2023/11/24
	21 西日本高速道	0.7540	100,000	103,586	2023/12/20
	1 三菱UFJFG 劣後	0.9400	100,000	103,503	2024/06/26
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,126	2026/08/21
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	120,258	2029/01/29
	107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	110,697	2045/01/27
種別小計	銘 柄 数	31銘柄			
	金 額		3,100,000	3,212,890	
合 計	銘 柄 数	362銘柄			
	金 額		62,523,000	67,712,446	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	67,712,446	99.2
コール・ローン等、その他	515,486	0.8
投資信託財産総額	68,227,933	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

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

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

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

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,937円です。

■損益の状況

当期 自 2016年12月1日 至 2017年11月30日

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

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

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

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

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

運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2018年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）」は、このたび、第2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/>

<2734>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) (ベンチマーク)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期 中 騰落率	期 中 騰落率	期 中 騰落率	期 中 騰落率			
1 期末 (2017年 6月15日)	円 9,710	円 0	% △ 2.9	円 9,751	% △ 2.5	% 93.8	% 4.0	百万円 33,745
2 期末 (2018年 6月15日)	円 9,475	円 0	% △ 2.4	円 9,567	% △ 1.9	% 95.4	% 2.1	百万円 61,154

(注1) FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) は、FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) は、FTSE Fixed Income LLC により運営されている債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。

(注2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注3) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

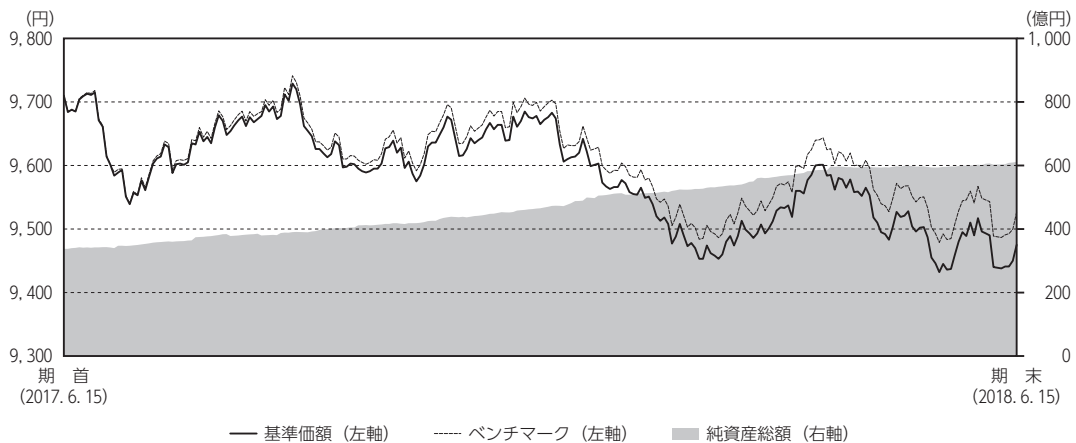
(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注5) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■ 基準価額・騰落率

期 首：9,710円
 期 末：9,475円
 騰落率：△2.4%

■ 基準価額の変動要因

日本を除く先進国国債に主に投資した結果、主要国の金利が上昇 (債券価格の下落) したことから、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%		%	%	%
(期首)2017年6月15日	9,710	—	9,751	—	93.8	4.0
6月末	9,614	△ 1.0	9,656	△ 1.0	97.9	1.0
7月末	9,601	△ 1.1	9,649	△ 1.1	95.3	0.9
8月末	9,685	△ 0.3	9,736	△ 0.2	98.4	—
9月末	9,598	△ 1.2	9,651	△ 1.0	97.7	1.7
10月末	9,630	△ 0.8	9,689	△ 0.6	93.2	3.4
11月末	9,639	△ 0.7	9,700	△ 0.5	95.4	1.5
12月末	9,622	△ 0.9	9,684	△ 0.7	92.1	6.7
2018年1月末	9,513	△ 2.0	9,582	△ 1.7	91.1	3.9
2月末	9,474	△ 2.4	9,548	△ 2.1	91.4	1.6
3月末	9,600	△ 1.1	9,681	△ 0.7	97.0	—
4月末	9,503	△ 2.1	9,588	△ 1.7	95.7	2.9
5月末	9,490	△ 2.3	9,581	△ 1.7	93.4	1.6
(期末)2018年6月15日	9,475	△ 2.4	9,567	△ 1.9	95.4	2.1

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017.6.16～2018.6.15)

■外国債券市況

主要国の国債金利は、期を通して上昇しました。期首より、ECB（欧州中央銀行）などが金融緩和姿勢を後退させる中で、ドイツなどを中心に金利は上昇しました。2017年8月には地政学リスクが意識され金利は低下しましたが、9月にFOMC（米国連邦公開市場委員会）で2017年内の追加利上げの可能性が示唆されたことなどから、金利は上昇しました。12月以降も、日本やユーロ圏などの主要先進国において金融政策の正常化観測が高まったことなどから、金利は上昇しました。2018年2月半ば以降は、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことを受けて市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、長期年限を中心に金利は低下傾向となりました。その後、金利は上昇しましたが、5月下旬にイタリアの政治不安を受けたリスク回避姿勢の高まりから、再び低下しました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

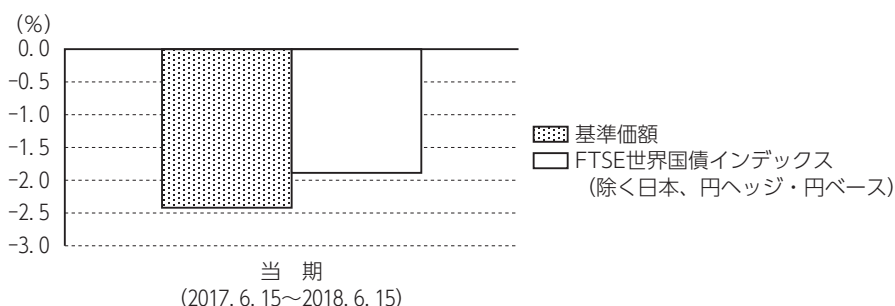
外貨建資産については為替ヘッジを行ない、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

ベンチマークとの差異について

当期のベンチマーク (FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)) の騰落率は△1.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△2.4%となりました。

当期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー (両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの) は0.08%程度でした。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳 (1万口当り)

項 目	当 期	
	2017年 6月16日	2018年 6月15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)	—	99

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2017. 6. 16~2018. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	39円	0.410%	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9,583円です。
（投信会社）	(27)	(0.281)	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）	(10)	(0.108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託銀行）	(2)	(0.021)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0.002	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物）	(0)	(0.002)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	2	0.020	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.015)	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）	(0)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	41	0.432	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	33,398,583	32,179,024	3,986,581	3,845,565

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	34,623,272	64,035,275	61,096,056	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	61,096,056	99.6
コール・ローン等、その他	266,666	0.4
投資信託財産総額	61,362,722	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相場場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.68円、1カナダ・ドル=84.33円、1オーストラリア・ドル=82.53円、1シンガポール・ドル=82.20円、1イギリス・ポンド=146.66円、1スイス・フラン=110.92円、1デンマーク・クローネ=17.17円、1ノルウェー・クローネ=13.60円、1スウェーデン・クローネ=12.64円、1メキシコ・ペソ=5.31円、1マレーシア・リンギット=27.78円、1南アフリカ・ランド=8.22円、1ポーランド・ズロチ=29.84円、1ユーロ=127.90円です。

(注3) 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(63,653,511千円)の投資信託財産総額(66,657,577千円)に対する比率は、95.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	61,362,722,902円
コール・ローン等	266,666,735
外国債券インデックス(為替ヘッジあり) マザーファンド(評価額)	61,096,056,167
(B) 負債	207,838,726
未払解約金	93,344,219
未払信託報酬	113,433,010
その他未払費用	1,061,497
(C) 純資産総額(A-B)	61,154,884,176
元本	64,540,834,408
次期繰越損益金	△ 3,385,950,232
(D) 受益権総口数	64,540,834,408口
1万口当り基準価額(C/D)	9,475円

*期首における元本額は34,752,986,225円、当期中における追加設定元本額は41,568,085,908円、同解約元本額は11,780,237,725円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,475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3,385,950,232円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 84,037円
受取利息	7,700
支払利息	△ 91,737
(B) 有価証券売買損益	△ 847,055,644
売買益	83,184,560
売買損	△ 930,240,204
(C) 信託報酬等	△ 196,997,250
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,044,136,931
(E) 前期繰越損益金	271,345,546
(F) 追加信託差損益金	△ 2,613,158,847
(配当等相当額)	(371,049,308)
(売買損益相当額)	(△ 2,984,208,155)
(G) 合計(D+E+F)	△ 3,385,950,232
次期繰越損益金(G)	△ 3,385,950,232
追加信託差損益金	△ 2,613,158,847
(配当等相当額)	(371,049,308)
(売買損益相当額)	(△ 2,984,208,155)
分配準備積立金	271,363,864
繰越損益金	△ 1,044,155,249

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

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

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	371,049,308
(d) 分配準備積立金	271,363,864
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	642,413,172
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	642,413,172
(h) 受益権総口数	64,540,834,408口

《お知らせ》

■運用において参照している指数の名称変更について
「シティ世界国債インデックス」を「FTSE世界国債インデックス」に変更しました。

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

運用報告書 第2期（決算日 2018年6月15日）

（計算期間 2017年6月16日～2018年6月15日）

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの第2期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
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FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。 ②運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ③投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させるため、外貨建資産については為替ヘッジを行いません。
株式組入制限	純資産総額の10%以下

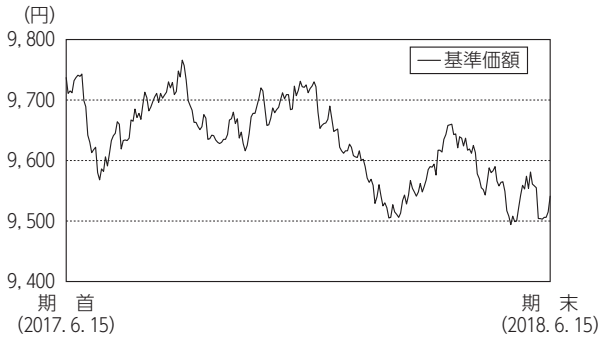
大和投資信託

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



《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：9,737円 期末：9,541円 騰落率：△2.0%

【基準価額の主な変動要因】

日本を除く先進国国債に投資した結果、各国の金利が上昇（債券価格の下落）したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○外国債券市況

主要国の国債金利は、期を通して上昇しました。期首より、ECB（欧州中央銀行）などが金融緩和姿勢を後退させる中で、ドイツなどを中心に金利は上昇しました。2017年8月には地政学リスクが意識され金利は低下しましたが、9月にFOMC（米連邦公開市場委員会）で2017年内の追加利上げの可能性が示唆されたことなどから、金利は上昇しました。12月以降は、日本やユーロ圏などの主要先進国において金融政策の正常化観測が高まったことなどから、金利は上昇しました。2018年2月半ば以降は、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことを受けて市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、長期年限を中心に金利は低下傾向となりました。その後、金利は上昇しましたが、5月下旬にイタリアの政治不安を受けたリスク回避姿勢の高まりから、再び低下しました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当期の当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率は、「当期中の基準価額と市況の推移」をご参照ください。当期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.07%程度でした。

《今後の運用方針》

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

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）		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)2017年6月15日	9,737	—	9,751	—	93.8	4.0
6月末	9,642	△ 1.0	9,656	△ 1.0	98.0	1.0
7月末	9,633	△ 1.1	9,649	△ 1.1	95.4	0.9
8月末	9,720	△ 0.2	9,736	△ 0.2	98.5	—
9月末	9,636	△ 1.0	9,651	△ 1.0	97.8	1.7
10月末	9,672	△ 0.7	9,689	△ 0.6	93.2	3.4
11月末	9,684	△ 0.5	9,700	△ 0.5	95.5	1.5
12月末	9,670	△ 0.7	9,684	△ 0.7	92.1	6.7
2018年1月末	9,564	△ 1.8	9,582	△ 1.7	91.2	3.9
2月末	9,528	△ 2.1	9,548	△ 2.1	91.5	1.6
3月末	9,658	△ 0.8	9,681	△ 0.7	97.1	—
4月末	9,564	△ 1.8	9,588	△ 1.7	95.8	2.9
5月末	9,554	△ 1.9	9,581	△ 1.7	93.5	1.6
(期末)2018年6月15日	9,541	△ 2.0	9,567	△ 1.9	95.5	2.1

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注5) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (先物)	0円 (0)
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	1 (1)
(その他)	(0)
合 計	2

(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

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカ・ドル 163,205	千アメリカ・ドル 38,456 (—)
	カナダ	千カナダ・ドル 11,751	千カナダ・ドル 2,617 (—)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 8,897	千オーストラリア・ドル 567 (—)
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,267	千シンガポール・ドル — (—)
	イギリス	千イギリス・ポンド 15,219	千イギリス・ポンド 757 (—)
	スイス	千スイス・フラン 277	千スイス・フラン — (—)
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 9,311	千デンマーク・クローネ 332 (—)
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 5,193	千ノルウェー・クローネ 1,315 (—)
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 10,867	千スウェーデン・クローネ 3,142 (—)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 45,780	千メキシコ・ペソ 7,033 (—)

■ 主要な売買銘柄

公 社 債

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2020/11/15	2,250,639	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2018/12/31	1,514,536
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/9/30	1,288,601	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.875% 2019/5/15	930,753
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2019/10/31	1,080,802	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2018/10/31	666,443
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1% 2019/11/15	1,071,093	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2019/10/31	656,168
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/2/28	1,019,721	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1% 2019/11/15	234,971
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2025/8/15	982,367	CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ) 1.75% 2019/3/1	219,795
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2024/5/15	926,726	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア) 4.5% 2018/8/1	207,619
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2023/5/15	911,983	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 1% 2019/5/25	191,365
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2043/5/15	812,683	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 3.75% 2019/1/4	165,622
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2024/11/15	801,927	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4.25% 2018/10/25	135,148

(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。

		買付額	売付額
外	マレーシア	千マレーシア・リンギット 6,942	千マレーシア・リンギット 763 (—)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 20,525	千南アフリカ・ランド — (—)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 7,910	千ポーランド・ズロチ 1,230 (—)
	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 2,226	千ユーロ — (—)
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 5,948	千ユーロ 1,002 (—)
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 6,273	千ユーロ 427 (—)
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 29,343	千ユーロ 3,075 (—)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 19,254	千ユーロ 1,566 (—)
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 15,396	千ユーロ 1,006 (—)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 25,266	千ユーロ 2,113 (—)
国	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 1,559	千ユーロ — (—)
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 4,136	千ユーロ 502 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 109,405	千ユーロ 9,693 (—)

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額 百万円	決 済 額 百万円	新規売付額 百万円	決 済 額 百万円
外 国 債券先物取引	30,291	30,162	—	—

(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（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	当 期			組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率			
		評 価 額		%			%	5年以上	2年以上	2年未満
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額							
アメリカ	千アメリカ・ドル 250,848	千アメリカ・ドル 247,571	千円 27,401,194	41.6	—	17.9	17.7	6.0		
カナダ	千カナダ・ドル 15,864	千カナダ・ドル 16,695	1,407,919	2.1	—	0.8	0.6	0.8		
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 15,297	千オーストラリア・ドル 16,399	1,353,423	2.1	—	1.3	0.6	0.1		
シンガポール	千シンガポール・ドル 2,667	千シンガポール・ドル 2,685	220,728	0.3	—	0.2	0.0	0.1		
イギリス	千イギリス・ポンド 24,047	千イギリス・ポンド 30,675	4,498,881	6.8	—	5.2	1.1	0.5		
スイス	千スイス・フラン 552	千スイス・フラン 682	75,715	0.1	—	0.1	0.0	—		
デンマーク	千デンマーク・クローネ 16,410	千デンマーク・クローネ 20,239	347,506	0.5	—	0.4	0.1	0.1		
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 9,650	千ノルウェー・クローネ 9,975	135,667	0.2	—	0.1	0.1	—		
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 15,650	千スウェーデン・クローネ 17,882	226,032	0.3	—	0.2	0.1	—		
メキシコ	千メキシコ・ペソ 82,030	千メキシコ・ペソ 81,660	433,614	0.7	—	0.4	0.2	0.1		
マレーシア	千マレーシア・リンギット 10,330	千マレーシア・リンギット 10,123	281,223	0.4	—	0.3	0.1	0.0		
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 41,430	千南アフリカ・ランド 38,181	313,856	0.5	—	0.4	0.1	0.0		
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 13,175	千ポーランド・ズロチ 13,504	402,985	0.6	—	0.2	0.3	0.1		
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 3,678	千ユーロ 4,139	529,453	0.8	—	0.4	0.3	0.1		
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 9,212	千ユーロ 10,695	1,367,958	2.1	—	1.4	0.5	0.2		
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 11,130	千ユーロ 12,439	1,590,975	2.4	—	1.8	0.5	0.1		
ユーロ (フランス)	千ユーロ 44,510	千ユーロ 52,249	6,682,731	10.2	—	6.4	3.1	0.6		
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 31,694	千ユーロ 36,291	4,641,639	7.1	—	4.0	2.1	0.9		
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 25,130	千ユーロ 29,111	3,723,340	5.7	—	3.9	1.2	0.5		
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 40,799	千ユーロ 45,788	5,856,341	8.9	—	5.6	2.6	0.7		
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 2,710	千ユーロ 2,982	381,408	0.6	—	0.3	0.2	0.1		
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 6,180	千ユーロ 7,423	949,499	1.4	—	1.0	0.4	—		
ユーロ (小計)	175,043	201,120	25,723,348	39.1	—	24.7	11.1	3.3		
合計	—	—	62,822,098	95.5	—	52.3	32.1	11.1		

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国（外貨建）公社債（銘柄別）

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期			償還年月日
				額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	%	千アメリカ・ドル 25,370	千アメリカ・ドル 25,359	千円 2,806,744	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	10,040	10,287	1,138,607	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	11,946	11,659	1,290,464	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,700	6,374	705,546	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	7,950	7,782	861,375	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	11,020	10,481	1,160,038	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,540	7,433	822,785	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,310	3,257	360,511	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,905	5,877	650,500	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	10,580	10,363	1,147,024	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,990	4,906	543,058	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	2,250	2,836	313,989	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	3,000	3,986	441,198	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,130	1,416	156,774	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,250	1,511	167,262	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,330	3,581	396,405	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	410	497	55,035	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	350	439	48,591	2040/02/15

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	期 末			償還年月日
				額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	670	857	94,913	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,970	3,008	332,930	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	8,210	7,945	879,432	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	1,208	133,751	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	332	372	41,189	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	2,600	2,745	303,839	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,190	3,226	357,065	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	12,440	12,274	1,358,505	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	9,810	9,438	1,044,706	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	13,150	12,681	1,403,584	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,570	1,552	171,784	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	12,320	11,591	1,282,921	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	16,720	16,013	1,772,346	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,900	3,724	412,257	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,820	201,470	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,165	1,057	117,065	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,070	1,850	204,835	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	895	99,152	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,350	2,185	241,870	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,480	2,389	264,426	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	10,500	10,282	1,138,025	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,120	4,849	536,704	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,500	5,412	599,061	2020/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,850	1,767	195,654	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,250	2,222	245,934	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,310	5,923	655,558	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,200	2,225	246,291	2048/05/15
通貨小計	銘柄数 金 額	45銘柄		250,848	247,571	27,401,194	
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	460	524	44,195	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	707	942	79,500	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	250	358	30,199	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	668	941	79,369	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	170	220	18,585	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	5,820	5,992	505,362	2020/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	409	34,569	2022/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	880	1,091	92,009	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,238	1,200	101,233	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	230	233	19,722	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	592	592	49,989	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	320	302	25,522	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,959	1,880	158,541	2021/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	930	834	70,406	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,240	1,170	98,710	2022/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		15,864	16,695	1,407,919	
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	5.7500	1,770	1,949	160,915	2021/05/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	800	835	68,926	2020/04/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,080	1,226	101,229	2022/07/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,383	1,581	130,488	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,089	1,265	104,442	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	656	665	54,939	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	920	964	79,591	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,200	1,251	103,249	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	859	1,023	84,430	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	998	1,111	91,727	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	300	302	25,003	2019/10/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	725	796	65,697	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	400	396	32,743	2020/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	684	697	57,527	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,158	2,069	170,808	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	275	262	21,703	2047/03/21
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		15,297	16,399	1,353,423	
シンガポール				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	203	218	17,958	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.5000	125	125	10,345	2019/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	150	155	12,764	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	300	305	25,091	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	390	392	32,224	2021/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	89	86	7,074	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	204	16,805	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	120	127	10,499	2033/09/01

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	300	299	24,600	2019/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400	398	32,748	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	330	317	26,128	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	60	54	4,487	2036/08/01
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄		2,667	2,685	220,728	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	千イギリス・ポンド 750	千イギリス・ポンド 793	116,359	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,300	1,325	194,331	2021/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	910	1,193	175,100	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	525	534	78,385	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	250	245	36,047	2022/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	850	840	123,338	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	863	1,248	183,042	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	350	465	68,326	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	675	843	123,739	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,165	1,618	237,323	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,090	1,167	171,159	2020/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	620	963	141,367	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	411	633	92,959	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	1,238	181,620	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,893	3,050	447,424	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,430	2,063	302,673	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,040	1,161	170,321	2022/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,045	1,085	159,135	2019/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	787	1,361	199,655	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	810	864	126,829	2020/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	742	811	119,054	2021/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	580	599	87,961	2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,425	1,853	271,896	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,290	1,369	200,819	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	748	1,251	183,597	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	300	329	48,295	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,290	1,759	258,113	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	27銘柄		24,047	30,675	4,498,881	
スイス	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	千スイス・フラン 282	千スイス・フラン 393	43,597	2028/04/08
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	120	127	14,158	2020/07/06
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	150	161	17,959	2021/04/28
通貨小計	銘柄数 金 額	3銘柄		552	682	75,715	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 4,140	千デンマーク・クローネ 7,011	120,388	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,760	2,942	50,514	2019/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,310	2,580	44,307	2021/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,670	2,896	49,730	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,330	2,597	44,597	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	2,211	37,967	2027/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		16,410	20,239	347,506	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	千ノルウェー・クローネ 2,620	千ノルウェー・クローネ 2,820	38,353	2021/05/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,150	1,183	16,094	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,300	1,407	19,147	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	150	151	2,060	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,430	1,412	19,216	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,000	2,999	40,795	2027/02/17
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		9,650	9,975	135,667	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	千スウェーデン・クローネ 2,780	千スウェーデン・クローネ 3,165	40,007	2020/12/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,920	2,715	34,322	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,950	3,393	42,898	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,150	2,328	29,438	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,020	2,342	29,607	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,280	1,344	16,991	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,592	32,766	2028/05/12
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		15,650	17,882	226,032	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.0000	千メキシコ・ペソ 5,400	千メキシコ・ペソ 5,185	27,534	2019/12/11
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	4,200	3,669	19,485	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	1,450	1,445	7,675	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	6,740	6,747	35,828	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,340	7,004	37,193	2024/12/05

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	期 末			償還年月日
				額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	4,800	4,664	24,770	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,750	3,279	17,415	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,500	6,762	35,908	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	5,000	5,246	27,858	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	5,500	5,519	29,309	2020/06/11
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	13,700	13,192	70,050	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	2,700	2,652	14,085	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	8,900	8,448	44,862	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	4,750	4,613	24,496	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	3,300	3,228	17,140	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		82,030	81,660	433,614	
マレーシア				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,760	1,741	48,374	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,250	1,207	33,549	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,050	1,049	29,152	2020/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	600	541	15,037	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,150	1,128	31,353	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,100	1,095	30,425	2022/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	600	595	16,533	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	1,420	1,374	38,178	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	400	399	11,102	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,000	990	27,515	2037/04/07
通貨小計	銘柄数 金 額	10銘柄		10,330	10,123	281,223	
南アフリカ				千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	1,210	1,205	9,909	2020/01/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	5,010	5,469	44,958	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	1,200	1,166	9,585	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	2,610	1,832	15,060	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	2,900	2,838	23,330	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	8,400	7,536	61,949	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	5,250	4,718	38,786	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	2,850	2,579	21,201	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	2,300	2,070	17,017	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	9,700	8,766	72,058	2032/03/31
通貨小計	銘柄数 金 額	10銘柄		41,430	38,181	313,856	
ポーランド				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,200	1,367	40,798	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000	1,120	1,182	35,280	2019/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000	1,340	1,339	39,968	2020/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	640	612	18,284	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,000	2,009	59,972	2021/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	1,520	1,512	45,143	2021/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,815	1,719	51,316	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	800	801	23,924	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	600	742	22,158	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	710	760	22,691	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,430	1,455	43,446	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄		13,175	13,504	402,985	
ユーロ (アイルランド)				千ユーロ	千ユーロ		
	IRISH TREASURY	国債証券	4.4000	290	304	38,895	2019/06/18
	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	288	382	48,932	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	910	1,027	131,428	2020/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	420	497	63,684	2023/03/20
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	100	118	15,124	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	680	774	99,064	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	310	324	41,547	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	320	328	42,017	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	170	173	22,201	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	4.5000	190	207	26,555	2020/04/18
国 小 計	銘柄数 金 額	10銘柄		3,678	4,139	529,453	
ユーロ (オランダ)				千ユーロ	千ユーロ		
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	580	853	109,187	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	455	692	88,553	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,170	1,384	177,057	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	200	210	26,874	2019/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	175	190	24,322	2020/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	430	672	86,048	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	492	549	70,244	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	590	723	92,536	2033/01/15

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	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	千円	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	540	750	95,969	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	380	424	54,319	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	850	862	110,289	2020/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	690	691	88,425	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	370	374	47,896	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	420	425	54,414	2022/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	470	481	61,579	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	799	102,253	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	600	609	77,984	2028/07/15
国小計	銘柄数 金額	17銘柄		9,212	10,695	1,367,958	
ユーロ（ベルギー）				千ユーロ	千ユーロ		
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	670	691	88,418	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,022	1,016	130,034	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	410	442	56,551	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	618	79,069	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	564	550	70,465	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	400	403	51,616	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	580	587	75,134	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	340	43,556	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	680	681	87,114	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	504	64,524	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	200	313	40,112	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	550	640	81,928	2022/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	534	586	75,031	2020/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	665	1,018	130,222	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	500	577	73,802	2021/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	300	394	50,402	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	730	871	111,455	2022/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	700	731	93,614	2019/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	120	175	22,424	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	916	117,261	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	377	48,232	2034/06/22
国小計	銘柄数 金額	21銘柄		11,130	12,439	1,590,975	
ユーロ（フランス）				千ユーロ	千ユーロ		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,415	3,429	438,579	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,000	1,495	191,315	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	900	1,473	188,438	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,310	2,037	260,565	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,182	1,904	243,588	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	650	728	93,140	2021/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,065	1,579	202,014	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,200	1,475	188,765	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	743	1,191	152,449	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	860	910	116,420	2019/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	500	537	68,744	2020/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,040	1,294	165,578	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,270	4,572	584,837	2020/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,514	1,698	217,286	2021/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	2,142	274,047	2022/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,710	2,045	261,595	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	995	1,101	140,883	2022/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	870	1,193	152,656	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,530	1,668	213,435	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,400	1,578	201,909	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,486	2,942	376,381	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,060	1,166	149,193	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,690	1,716	219,503	2019/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,219	155,990	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	600	603	77,238	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,036	388,331	2021/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,570	2,517	322,030	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	650	693	88,690	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	900	971	124,211	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,204	154,103	2023/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,300	1,305	166,928	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	800	812	103,874	2034/05/25
国小計	銘柄数 金額	32銘柄		44,510	52,249	6,682,731	
ユーロ（ドイツ）				千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	855	1,328	169,867	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,146	1,884	241,069	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	160	255	32,625	2031/01/04

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	千円	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	370	591	75,596	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	890	1,365	174,591	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	720	1,173	150,131	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	360	631	80,714	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,334	1,392	178,159	2019/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	306	451	57,771	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,655	2,890	369,640	2021/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,542	1,675	214,273	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,248	1,649	211,034	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,150	1,245	159,247	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	960	1,068	136,621	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	500	552	70,633	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	725	968	123,856	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	990	1,080	138,257	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,225	156,776	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,800	1,914	244,914	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	883	904	115,734	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	950	931	119,102	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,000	995	127,306	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	1,012	129,477	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	280	286	36,665	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	251	32,190	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,440	1,458	186,489	2019/10/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,923	245,972	2020/04/17
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,440	3,509	448,810	2020/10/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,522	194,727	2022/04/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	150	151	19,376	2023/04/14
国 小 計	銘柄数 金 額	30銘柄		31,694	36,291	4,641,639	
ユーロ（スペイン）				千ユーロ	千ユーロ		
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,320	1,911	244,506	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	500	527	67,490	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	610	632	80,933	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,865	2,027	259,297	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	1,025	131,224	2021/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	889	971	124,271	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	280	330	42,236	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,749	1,777	227,316	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	350	353	45,273	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	600	614	78,604	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	920	974	124,589	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	670	680	86,977	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	350	351	44,943	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	280	421	53,933	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	800	1,072	137,118	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	400	589	75,344	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6000	1,238	1,307	167,204	2019/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	943	1,359	173,866	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,600	1,789	228,826	2020/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	724	840	107,473	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,140	1,379	176,435	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	810	1,000	128,008	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,588	1,919	245,544	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	600	815	104,265	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	340	524	67,065	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	700	829	106,054	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,384	1,563	200,009	2024/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,480	1,520	194,525	2020/01/31
国 小 計	銘柄数 金 額	28銘柄		25,130	29,111	3,723,340	
ユーロ（イタリア）				千ユーロ	千ユーロ		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	800	1,080	138,179	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,135	2,792	357,217	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	705	684	87,513	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	871	111,499	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	200	187	24,002	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	690	586	74,950	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	600	553	70,784	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	500	482	61,700	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,500	1,485	190,025	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	350	345	44,223	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	469	60,024	2028/02/01

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	末			償 還 年 月 日
					評 価 額			
					外 貨 建 金 額	千 円	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	740	901	115,291	2029/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,288	1,682	215,193	2031/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,000	1,301	166,406	2033/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,050	1,290	165,118	2034/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	770	852	109,060	2037/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	702	756	96,736	2021/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,640	2,021	258,517	2039/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,570	1,789	228,857	2023/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	3,470	3,625	463,669	2019/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,700	1,984	253,812	2025/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	664	818	104,628	2040/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	3,050	3,255	416,399	2020/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,850	2,111	270,110	2026/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,650	1,767	226,067	2021/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,320	1,465	187,476	2021/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	780	878	112,332	2022/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	2,770	3,206	410,125	2022/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,480	1,721	220,233	2028/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	395	476	60,997	2044/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	830	937	119,861	2024/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,110	2,295	293,630	2024/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	370	387	49,592	2030/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	700	720	92,102	2021/12/15	
国 小 計	銘柄数 金 額	34銘柄		40,799	45,788	5,856,341		
ユーロ（フィンランド）				千ユーロ	千ユーロ			
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	190	187	23,936	2031/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	180	181	23,191	2026/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	200	198	25,364	2027/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	4.3750	80	84	10,771	2019/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	252	32,242	2025/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	3.3750	200	214	27,440	2020/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	120	144	18,498	2028/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	980	1,057	135,223	2022/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	210	273	34,963	2042/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	350	389	49,775	2024/04/15	
国 小 計	銘柄数 金 額	10銘柄		2,710	2,982	381,408		
ユーロ（オーストリア）				千ユーロ	千ユーロ			
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	440	467	59,744	2025/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	490	499	63,929	2026/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	120	119	15,336	2047/02/20	
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	400	397	50,806	2027/04/20	
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	380	572	73,285	2027/07/15	
	Austria Government Bond	国債証券	3.9000	480	524	67,091	2020/07/15	
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	660	744	95,208	2021/09/15	
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	510	761	97,450	2037/03/15	
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	860	997	127,634	2022/11/22	
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	420	705	90,253	2062/01/26	
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	180	248	31,801	2044/06/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	680	744	95,196	2023/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	280	332	42,587	2034/05/23	
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	280	306	39,172	2024/10/21	
国 小 計	銘柄数 金 額	14銘柄		6,180	7,423	949,499		
通貨小計	銘柄数 金 額	196銘柄		175,043	201,120	25,723,348		
合 計	銘柄数 金 額	379銘柄				62,822,098		

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
外		
T-BOND (LONG BOND) (アメリカ)	79	—
T-NOTE (10YR) (アメリカ)	92	—
T-NOTE (5YR) (アメリカ)	125	—
T-NOTE (2YR) (アメリカ)	562	—
T-BOND (ULTRA LONG) (アメリカ)	34	—
GILT 10YR (イギリス)	35	—
国		
BOBL (5YR) (ドイツ)	117	—
SCHATZ (2YR) (ドイツ)	171	—
BUXL (30YR) (ドイツ)	66	—
BTP 10YR (イタリア)	96	—

(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。

■損益の状況

当期 自 2017年 6月16日 至 2018年 6月15日

項 目	当 期
(A)配当等収益	1,191,691,872円
受取利息	1,194,096,879
支払利息	△ 2,405,007
(B)有価証券売買損益	△ 2,173,073,541
売買益	5,746,772,048
売買損	△ 7,919,845,589
(C)先物取引等損益	△ 9,563,845
取引益	56,704,120
取引損	△ 66,267,965
(D)その他費用	△ 7,744,267
(E)当期損益金 (A+B+C+D)	△ 998,689,781
(F)前期繰越損益金	△ 932,929,950
(G)解約差損益金	143,125,149
(H)追加信託差損益金	△ 1,379,320,286
(I)合計 (E+F+G+H)	△ 3,167,814,868
次期繰越損益金 (I)	△ 3,167,814,868

(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。

■投資信託財産の構成

2018年 6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	62,822,098	94.2
コール・ローン等、その他	3,835,479	5.8
投資信託財産総額	66,657,577	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.68円、1カナダ・ドル=84.33円、1オーストラリア・ドル=82.53円、1シンガポール・ドル=82.20円、1イギリス・ポンド=146.66円、1スイス・フラン=110.92円、1デンマーク・クローネ=17.17円、1ノルウェー・クローネ=13.60円、1スウェーデン・クローネ=12.64円、1メキシコ・ペソ=5.31円、1マレーシア・リンギット=27.78円、1南アフリカ・ランド=8.22円、1ポーランド・ズロチ=29.84円、1ユーロ=127.90円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (63,653,511千円) の投資信託財産総額 (66,657,577千円) に対する比率は、95.5%です。

《お知らせ》

■運用において参照している指数の名称変更について
「シティ世界国債インデックス」を「FTSE 世界国債インデックス」に変更しました。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年 6月15日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	129,550,670,567円
コール・ローン等	3,262,746,442
公社債 (評価額)	62,822,098,221
未収入金	62,921,540,901
未取利息	420,542,318
前払費用	54,845,725
差入委託証拠金	68,896,960
(B)負債	63,749,120,046
未払金	63,749,095,800
その他未払費用	24,246
(C)純資産総額 (A-B)	65,801,550,521
元本	68,969,365,389
次期繰越損益金	△ 3,167,814,868
(D)受益権総口数	68,969,365,389口
1万口当り基準価額 (C/D)	9,541円

*期首における元本額は35,493,735,600円、当期中における追加設定元本額は37,519,095,983円、同解約元本額は4,043,466,194円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジあり) 64,035,275,304円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス (為替ヘッジあり) 3,469,288,196円、ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用) 1,464,801,889円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,541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3,167,814,868円です。

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)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果をFTSE 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います。	
主投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債
マザーファンドの運用方法	①主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利息等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の30%以下
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

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

運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2018年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）」は、このたび、第2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/>

<2735>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率				
1 期末 (2017年 6 月15日)	円 10,622	円 0	% 6.2	% 6.3	% 98.8	% —	百万円 1,404	
2 期末 (2018年 6 月15日)	円 10,709	円 0	% 0.8	% 1.8	% 98.6	% —	百万円 2,405	

(注1) FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、FTSE Fixed Income LLC により運営されている債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。

(注2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注3) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

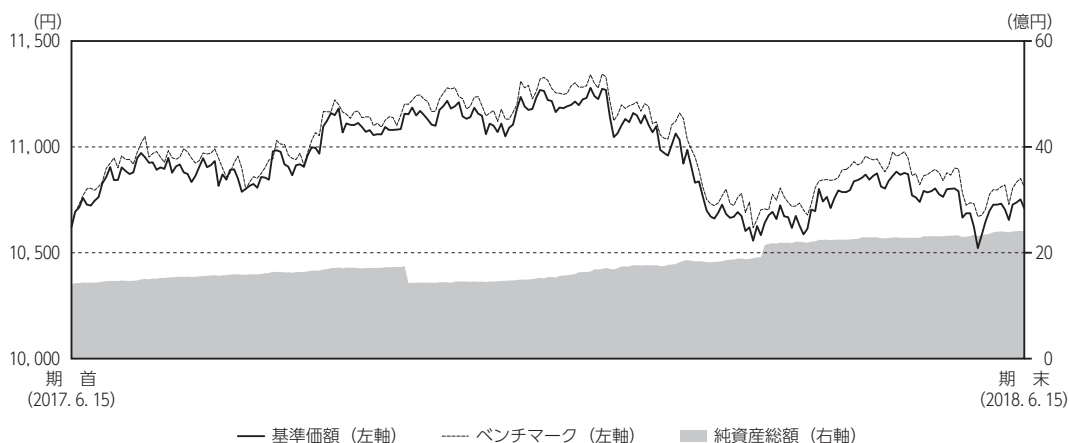
(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注5) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークは FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) です。

■ 基準価額・騰落率

期首：10,622円

期末：10,709円

騰落率：0.8%

■ 基準価額の主な変動要因

日本を除く先進国国債に投資した結果、債券市場で金利が上昇 (債券価格の下落) したものの、米ドルやユーロなどの対円為替レートの上昇がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%		%	%	%
(期首)2017年 6月15日	10,622	—	10,625	—	98.8	—
6月末	10,843	2.1	10,952	3.1	98.5	—
7月末	10,834	2.0	10,951	3.1	98.5	—
8月末	10,984	3.4	11,033	3.8	98.3	—
9月末	11,103	4.5	11,168	5.1	98.6	—
10月末	11,100	4.5	11,172	5.1	98.5	—
11月末	11,105	4.5	11,166	5.1	98.4	—
12月末	11,240	5.8	11,304	6.4	98.2	—
2018年 1月末	10,959	3.2	11,041	3.9	97.9	—
2月末	10,674	0.5	10,783	1.5	97.8	—
3月末	10,742	1.1	10,848	2.1	98.4	—
4月末	10,868	2.3	10,967	3.2	98.3	—
5月末	10,585	△ 0.3	10,681	0.5	98.1	—
(期末)2018年 6月15日	10,709	0.8	10,815	1.8	98.6	—

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■ 外国債券市況

主要国の国債金利は、期を通して上昇しました。期首より、ECB（欧州中央銀行）などが金融緩和姿勢を後退させる中で、ドイツなどを中心に金利は上昇しました。2017年8月には地政学リスクが意識され金利は低下しましたが、9月にFOMC（米国連邦公開市場委員会）で2017年内の追加利上げの可能性が示唆されたことなどから、金利は上昇しました。12月以降も、日本やユーロ圏などの主要先進国において金融政策の正常化観測が高まったことなどから、金利は上昇しました。2018年2月半ば以降は、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことを受けて市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、長期年限を中心に金利は低下傾向となりました。その後、金利は上昇しましたが、5月下旬にイタリアの政治不安を受けたリスク回避姿勢の高まりから、再び低下しました。

■ 為替相場

為替相場は、期を通しておおむね円安傾向となりました。期首より、ECBの金融緩和姿勢の後退がユーロなどの上昇要因となりました。2017年7月以降は、地政学リスクの高まりなどから円高傾向となりました。9月に入ると、FOMCで2017年内の追加利上げの可能性が示唆されたことなどから円安傾向となりました。その後、主要通貨はおおむね横ばいで推移しましたが、2018年に入ると、米国のムニューシン財務長官による米ドル安容認発言などから米ドルが下落しました。2月には、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことや各国の株価が急落したことなどから市場のリスク回避姿勢が強まり、円は上昇傾向となりました。4月以降は、米国金利が上昇したことなどから米ドルなどが上昇しました。一方、ユーロなどはイタリア情勢の影響から下落しました。

前期における「今後の運用方針」

■ 当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■ 外国債券インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れました。

■外国債券インデックスマザーファンド

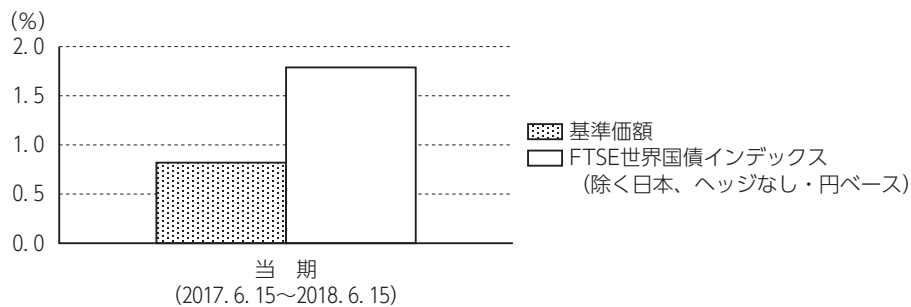
ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

ベンチマークとの差異について

当期のベンチマーク (FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)) の騰落率は1.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.8%となりました。

当期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー (両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの) は0.02%程度でした。ただし、これらはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳 (1万口当り)

項目	当 期	
	2017年6月16日 ~2018年6月15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)	708	

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



今後の運用方針

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2017. 6. 16~2018. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	45円	0.410%	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10,926円です。
（投信会社）	(31)	(0.281)	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）	(12)	(0.108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託銀行）	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 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
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	3	0.032	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）	(3)	(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）	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	48	0.442	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口数 千口	金額 千円	口数 千口	金額 千円
外国債券 インデックス マザーファンド	517,097	1,423,967	154,956	434,899

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表 親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数 千口	口数 千口	評価額 千円
外国債券インデックス マザーファンド	523,704	885,845	2,403,653

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックス マザーファンド	2,403,653	99.4
コール・ローン等、その他	13,406	0.6
投資信託財産総額	2,417,060	100.0

- (注1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.68円、1カナダ・ドル=84.33円、1オーストラリア・ドル=82.53円、1シンガポール・ドル=82.20円、1イギリス・ポンド=146.66円、1スイス・フラン=110.92円、1デンマーク・クローネ=17.17円、1ノルウェー・クローネ=13.60円、1スウェーデン・クローネ=12.64円、1メキシコ・ペソ=5.31円、1マレーシア・リンギット=27.78円、1南アフリカ・ランド=8.22円、1ポーランド・ズロチ=29.84円、1ユーロ=127.90円です。
 (注3) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(163,464,852千円)の投資信託財産総額(164,093,858千円)に対する比率は、99.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項目	当 期 末
(A) 資産	2,417,060,194円
コール・ローン等	13,406,974
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	2,403,653,220
(B) 負債	11,176,894
未払解約金	6,919,914
未払信託報酬	4,174,586
その他未払費用	82,394
(C) 純資産総額(A-B)	2,405,883,300
元本	2,246,613,872
次期繰越損益金	159,269,428
(D) 受益権総口数	2,246,613,872口
1万口当り基準価額(C/D)	10,709円

- *期首における元本額は1,322,658,686円、当期中における追加設定元本額は1,454,615,593円、同解約元本額は530,660,407円です。
 *当期末の計算口数当りの純資産額は10,709円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,434円
受取利息	249
支払利息	△ 2,683
(B) 有価証券売買損益	△ 8,401,005
売買益	16,793,337
売買損	△ 25,194,342
(C) 信託報酬等	△ 7,509,371
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 15,912,810
(E) 前期繰越損益金	9,444,056
(F) 追加信託差損益金	165,738,182
(配当等相当額)	(13,520,804)
(売買損益相当額)	(152,217,378)
(G) 合計(D+E+F)	159,269,428
次期繰越損益金(G)	159,269,428
追加信託差損益金	165,738,182
(配当等相当額)	(13,520,804)
(売買損益相当額)	(152,217,378)
分配準備積立金	9,444,467
繰越損益金	△ 15,913,221

- (注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
 (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
 (注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	149,827,806
(d) 分配準備積立金	9,444,467
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	159,272,273
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	159,272,273
(h) 受益権総口数	2,246,613,872口

《お知らせ》

■運用において参照している指数の名称変更について
 当ファンドおよび当ファンドの主要投資対象である「外国債券インデックスマザーファンド」において参照している指数の名称を「シティ世界国債インデックス」から「FTSE世界国債インデックス」に変更しました。

＜補足情報＞

当ファンド(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))が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日(2017年11月30日)と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日(2018年6月15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180～192ページに併せて掲載いたしました。

■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
 公 社 債

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2028/2/15	668,168	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.875% 2018/5/31	439,788
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2027/8/15	663,832	United Kingdom Gilt (イギリス) 1.25% 2018/7/22	410,942
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2027/11/15	590,244	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4.25% 2019/4/25	408,061
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2019/6/30	440,296	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2018/10/31	406,508
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2047/8/15	412,429	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2018/8/31	390,206
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.375% 2027/5/15	411,368	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1% 2018/5/31	375,037
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2020/11/15	405,018	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア) 4.5% 2019/3/1	369,211
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2024/10/31	394,123	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 4% 2018/8/15	366,817
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2022/11/30	388,154	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 3.75% 2019/1/4	366,384
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3% 2048/2/15	380,685	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4.25% 2018/10/25	357,139

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

■組入資産明細表

下記は、2018年6月15日現在における外国債券インデックスマザーファンド（60,439,178千円）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	2018年6月15日現在							
		評 価 額		組入比率	うちB格以下組入率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
			千円	%	%	%	%	%	
アメリカ	千アメリカ・ドル 661,524	千アメリカ・ドル 649,694	千円 71,908,195	43.8	—	18.3	17.3	8.3	
カナダ	千カナダ・ドル 38,138	千カナダ・ドル 40,123	3,383,654	2.1	—	0.9	0.6	0.6	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 39,919	千オーストラリア・ドル 42,073	3,472,316	2.1	—	1.3	0.6	0.2	
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,987	千シンガポール・ドル 8,089	664,963	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
イギリス	千イギリス・ポンド 62,191	千イギリス・ポンド 77,882	11,422,208	7.0	—	5.2	1.3	0.5	
スイス	千スイス・フラン 1,590	千スイス・フラン 1,921	213,101	0.1	—	0.0	0.1	—	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 45,172	千デンマーク・クローネ 55,798	958,060	0.6	—	0.4	0.1	0.1	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 27,302	千ノルウェー・クローネ 28,345	385,492	0.2	—	0.1	0.1	—	
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 44,065	千スウェーデン・クローネ 50,078	632,992	0.4	—	0.2	0.2	—	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 227,035	千メキシコ・ペソ 225,599	1,197,930	0.7	—	0.4	0.2	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 29,271	千マレーシア・リンギット 28,925	803,553	0.5	—	0.3	0.1	0.1	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 124,745	千南アフリカ・ランド 113,279	931,156	0.6	—	0.5	0.0	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 33,567	千ポーランド・ズロチ 34,455	1,028,153	0.6	—	0.2	0.3	0.1	
ユ ロ 区	アイルランド	千ユーロ 9,627	千ユーロ 10,632	1,359,894	0.8	—	0.5	0.2	0.2
	オランダ	千ユーロ 23,580	千ユーロ 27,544	3,522,916	2.1	—	1.4	0.6	0.2
	ベルギー	千ユーロ 26,664	千ユーロ 31,792	4,066,199	2.5	—	1.9	0.5	0.1
	フランス	千ユーロ 109,971	千ユーロ 128,579	16,445,302	10.0	—	6.3	2.6	1.1
	ドイツ	千ユーロ 77,343	千ユーロ 90,004	11,511,621	7.0	—	4.0	2.2	0.8
	スペイン	千ユーロ 64,410	千ユーロ 75,330	9,634,728	5.9	—	3.9	1.3	0.6
	イタリア	千ユーロ 107,296	千ユーロ 115,409	14,760,877	9.0	—	5.2	2.8	1.0
	フィンランド	千ユーロ 7,233	千ユーロ 7,892	1,009,467	0.6	—	0.3	0.2	0.1
	オーストリア	千ユーロ 16,658	千ユーロ 19,299	2,468,421	1.5	—	1.0	0.4	0.1
	小計	千ユーロ 442,782	千ユーロ 506,484	64,779,431	39.5	—	24.7	10.7	4.1
合 計	—	—	161,781,211	98.6	—	52.7	31.7	14.2	

(注1) 邦貨換算金額は、2018年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

2018年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	2,621	2,656	294,046	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,020	4,069	450,370	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,280	4,356	482,128	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,073	3,125	345,976	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,854	2,854	315,940	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,509	4,507	498,841	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,076	4,176	462,247	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,582	285,783	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,488	275,434	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,101	232,577	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,139	347,436	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,365	261,806	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,385	2,357	260,928	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,368	1,348	149,285	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,784	1,753	194,088	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,426	268,571	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,872	1,839	203,631	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,215	2,173	240,576	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	884	869	96,215	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,168	3,014	333,607	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,353	1,323	146,497	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,894	1,854	205,213	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,366	1,341	148,429	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,197	464,529	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,968	1,925	213,102	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,160	1,130	125,173	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,455	493,174	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,451	1,412	156,381	2020/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,461	2,404	266,126	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,131	2,101	232,540	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,827	2,792	309,028	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,768	2,723	301,478	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,993	1,972	218,291	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,885	1,858	205,746	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,345	2,297	254,270	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	4,997	553,117	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,501	2,462	272,547	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,006	1,992	220,514	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,199	575,441	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,647	1,624	179,810	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,734	1,703	188,573	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,821	2,788	308,640	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,912	3,831	424,117	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,407	2,378	263,241	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,241	2,223	246,084	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,732	2,678	296,436	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,885	2,862	316,853	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,485	3,426	379,270	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.1250	724	771	85,368	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.7500	642	724	80,168	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,464	272,824	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	761	84,288	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,036	114,754	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.5000	630	797	88,315	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	893	98,941	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	856	94,744	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	889	98,445	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	473	571	63,304	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	964	1,280	141,771	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	991	1,242	137,489	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,626	1,965	217,574	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	547	706	78,160	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	659	73,043	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	635	70,344	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,249	1,343	148,681	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,335	147,829	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	760	935	103,574	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,467	162,422	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,710	2,144	237,405	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,478	1,795	198,767	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,591	1,806	199,932	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,757	194,547	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,754	2,244	248,474	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,665	184,362	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,367	1,526	168,969	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,468	162,554	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,643	181,934	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,341	148,486	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,731	1,641	181,662	2042/08/15

2018年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,630	2,492	275,849	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,326	2,353	260,456	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,798	3,675	406,831	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,064	3,366	372,557	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	3,581	4,014	444,275	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,617	3,977	440,266	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,657	3,861	427,362	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,326	3,296	364,871	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,795	309,354	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,162	5,013	554,858	2024/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,729	3,771	417,397	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,989	2,959	327,550	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,272	140,799	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,404	3,372	373,250	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,555	393,563	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,190	3,147	348,362	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,111	233,731	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,697	630,551	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,696	3,654	404,471	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,804	310,350	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,325	4,262	471,788	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,102	343,344	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,204	2,174	240,621	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,963	3,882	429,747	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,427	2,321	256,991	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,429	600,923	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,763	3,376	373,698	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,788	2,733	302,499	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,809	1,744	193,086	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,792	2,734	302,643	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,785	308,274	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,503	609,129	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,835	3,791	419,614	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,607	2,550	282,275	2020/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,513	278,208	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,730	302,247	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,013	2,951	326,625	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,001	2,943	325,816	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,750	304,422	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,135	3,072	340,014	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,112	233,784	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,403	598,037	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,573	3,448	381,646	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,355	260,759	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,868	2,792	309,021	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,367	262,035	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,876	2,796	309,511	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,577	617,329	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,116	3,025	334,880	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	3,665	405,700	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,461	272,411	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,021	334,389	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,078	672,736	2022/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	2,975	329,352	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,492	2,419	267,840	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,126	3,024	334,713	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,366	4,883	540,546	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,444	270,517	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,428	3,067	339,542	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,309	3,175	351,502	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,262	4,016	444,556	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,887	319,539	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	1,998	221,204	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,029	5,473	605,825	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,361	261,376	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	1,957	216,685	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	3,060	338,721	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,598	287,629	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,362	261,437	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,100	2,069	229,039	2019/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,385	264,029	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,796	309,494	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,456	271,846	2019/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,600	5,016	555,254	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	2,946	326,155	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,451	271,370	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,519	389,486	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,525	390,158	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,570	284,539	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,230	246,891	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,600	2,549	282,156	2019/09/15

2018年6月15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	1.3750	2,505	2,324	257,324	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	2,888	319,719	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,147	2,105	232,996	2019/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,500	5,114	566,079	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,857	316,214	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,348	259,879	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,650	3,516	389,176	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,400	1,370	151,736	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,398	265,492	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,400	2,321	256,913	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,440	1,415	156,708	2019/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,949	215,737	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,422	268,094	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,500	1,473	163,054	2020/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,340	5,057	559,765	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,918	322,995	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,401	265,757	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,875	3,827	423,656	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,130	2,089	231,262	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,915	322,735	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,210	244,658	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,900	1,869	206,948	2020/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,550	2,448	271,009	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,806	310,639	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	850	833	92,295	2020/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,700	5,446	602,827	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,500	3,456	382,564	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	2,900	321,066	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	2,858	316,397	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	3,920	433,878	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,884	319,276	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,958	438,133	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,904	210,741	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,700	2,643	292,590	2020/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,953	437,615	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,881	318,964	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,282	252,661	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,000	1,955	216,472	2020/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	988	109,403	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,569	616,482	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,300	1,269	140,561	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,797	309,609	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,872	317,928	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,800	3,566	394,789	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,100	2,003	221,694	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	600	591	65,466	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,886	208,804	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,500	2,432	269,229	2020/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,407	266,473	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	985	109,127	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,250	359,758	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,000	977	108,176	2020/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,418	267,640	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,186	574,017	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,100	2,909	322,037	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,369	372,911	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,600	3,525	390,180	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,800	2,769	306,526	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,962	217,216	2020/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,055	338,153	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	1,000	990	109,594	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,300	1,249	138,341	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,300	2,262	250,376	2021/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,300	2,280	252,405	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,433	380,054	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,300	6,195	685,730	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,800	1,791	198,265	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,473	273,725	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,273	362,358	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,538	280,933	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,675	296,101	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,600	3,553	393,308	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,200	3,174	351,339	2021/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,500	1,491	165,105	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	2,859	316,507	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	2,849	315,428	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,500	2,478	274,353	2021/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,200	1,213	134,340	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,400	1,391	154,031	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,000	2,994	331,402	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,200	1,195	132,343	2020/04/30

外国債券インデックスマザーファンド

2018年6月15日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,492	275,878	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,896	209,896	2025/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,400	1,398	154,739	2020/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,896	209,896	2025/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,492	275,878	2023/05/31	
通貨小計	銘柄数	246銘柄						
	金 額			661,524	649,694	71,908,195		
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	425	484	40,832	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	386	564	47,596	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,310	110,536	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,614	136,140	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,112	1,566	132,123	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,524	1,553	130,965	2019/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	1,767	149,015	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,876	1,931	162,896	2020/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	989	83,404	2021/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,794	151,329	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,561	1,935	163,212	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,214	102,459	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,428	120,478	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,627	1,625	137,114	2019/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,197	1,314	110,845	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,157	97,614	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,719	1,707	143,976	2020/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,831	1,783	150,390	2020/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,129	1,067	90,047	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,237	1,196	100,875	2021/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,480	1,420	119,776	2021/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,113	93,875	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	840	792	66,868	2022/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,337	112,815	2022/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,360	1,344	113,399	2019/08/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	500	495	41,826	2019/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	585	49,360	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,600	1,572	132,573	2023/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,600	1,583	133,526	2020/02/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	700	697	58,836	2020/05/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	595	50,178	2023/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	279	23,571	2051/12/01	
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	300	298	25,188	2020/08/01		
通貨小計	銘柄数	33銘柄						
	金 額			38,138	40,123	3,383,654		
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,665	220,008	2021/05/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,409	2,514	207,554	2020/04/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,162	2,455	202,646	2022/07/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,364	195,119	2023/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,008	248,301	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,473	2,509	207,111	2024/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,074	2,174	179,426	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,398	2,500	206,327	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,358	1,617	133,476	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,848	3,171	261,763	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,011	2,030	167,605	2019/10/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,222	100,856	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	557	536	44,313	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,195	2,177	179,682	2020/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	712	725	59,881	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,522	2,529	208,800	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,978	1,897	156,561	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,132	1,082	89,341	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	1,787	147,545	2021/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,200	2,203	181,865	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	299	24,689	2022/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	600	599	49,437	2029/11/21	
	通貨小計	銘柄数	22銘柄					
		金 額			39,919	42,073	3,472,316	
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	696	715	58,778	2020/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	830	68,293	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	455	37,450	2022/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.5000	599	603	49,577	2019/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	623	644	53,013	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	359	365	30,026	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	495	497	40,900	2021/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	386	31,794	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	491	501	41,257	2023/07/01	

2018年6月15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	
			%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	368	391	32,197	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	125	128	10,526	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	415	413	34,030	2019/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	124	123	10,152	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	224	224	18,431	2020/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	568	547	44,972	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	250	243	20,046	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	190	184	15,204	2021/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	197	16,206	2022/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	150	136	11,218	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	196	16,128	2023/02/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	300	301	24,755	2028/05/01
通貨小計	銘柄数	21銘柄					
	金 額			7,987	8,089	664,963	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,280	2,340	343,309	2020/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,821	1,926	282,520	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,524	370,277	2021/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,582	2,075	304,405	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,491	218,732	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,300	1,278	187,447	2022/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	910	857	125,759	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	400	399	58,587	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,130	1,173	172,073	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,210	1,197	175,575	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	1,000	985	144,460	2023/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	500	507	74,400	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	430	442	64,936	2071/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,337	196,131	2021/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,372	201,282	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,340	1,783	261,593	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,839	269,843	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,032	2,822	413,940	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,457	2,215	324,948	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,724	1,845	270,715	2020/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,958	433,857	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,086	3,243	475,633	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,551	227,585	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,596	2,461	360,981	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,480	2,019	296,195	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,523	2,454	359,972	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,246	1,798	263,728	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,543	226,331	2022/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,620	2,269	332,814	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,428	1,482	217,460	2019/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,244	2,151	315,593	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,795	1,916	281,061	2020/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,307	338,413	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	803	878	128,841	2021/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,352	2,077	304,663	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,318	340,017	2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,966	2,557	375,121	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,942	2,061	302,318	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,621	2,709	397,399	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,251	2,278	334,195	2019/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,392	1,527	224,092	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	2,897	424,987	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	42銘柄					
	金 額			62,191	77,882	11,422,208	
スイス	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	千スイス・フラン	千スイス・フラン		
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	404	489	54,340	2023/02/11
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	497	692	76,836	2028/04/08
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	327	347	38,583	2020/07/06
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	362	390	43,341	2021/04/28
合 計	銘柄数	4銘柄					
	金 額			1,590	1,921	213,101	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	11,512	19,496	334,762	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	8,601	9,168	157,418	2019/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	5,550	6,199	106,453	2021/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,256	90,260	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	8,363	9,322	160,072	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,800	4,824	82,837	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,529	26,254	2020/11/15
通貨小計	銘柄数	7銘柄					
	金 額			45,172	55,798	958,060	

外国債券インデックスマザーファンド

2018年6月15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	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	千ノルウェー・クローネ 6,998	千ノルウェー・クローネ 7,532	千円 102,442	2021/05/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	6,024	6,198	84,305	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,434	60,315	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,428	46,630	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,300	44,883	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,450	3,449	46,914	2027/02/17
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		27,302	28,345	385,492	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	千スウェーデン・クローネ 9,095	千スウェーデン・クローネ 10,355	130,887	2020/12/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	5,876	74,276	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	9,738	123,096	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,609	96,187	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,095	5,908	74,679	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,680	5,965	75,399	2026/11/12
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		44,065	50,078	632,992	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.0000	千メキシコ・ペソ 21,447	千メキシコ・ペソ 20,594	109,358	2019/12/11
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	13,290	11,611	61,657	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	7,000	6,977	37,052	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	10,000	9,788	51,977	2021/12/09
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	10,633	10,644	56,522	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	22,119	24,436	129,759	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	14,668	14,255	75,695	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,874	8,198	43,533	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	8,844	9,200	48,857	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	9,694	10,171	54,012	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	18,928	18,995	100,868	2020/06/11
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	27,826	26,794	142,278	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	12,786	67,895	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	17,099	16,231	86,190	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	18,654	18,117	96,202	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	6,944	6,792	36,068	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		227,035	225,599	1,197,930	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7340	千マレーシア・リンギット 647	千マレーシア・リンギット 663	18,425	2019/07/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	573	535	14,868	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.2480	738	784	21,789	2028/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	1,603	1,622	45,085	2019/11/29
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,165	32,377	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,916	1,941	53,937	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,520	42,235	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,241	34,496	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	858	23,856	2022/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	706	19,619	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1270	618	580	16,134	2032/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,044	1,043	28,986	2020/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	980	27,236	2023/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	927	836	23,232	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	586	563	15,644	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8890	656	660	18,336	2020/07/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	603	16,773	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,060	29,465	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	857	865	24,030	2021/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6540	648	649	18,056	2019/10/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	737	723	20,093	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	700	701	19,496	2020/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,155	32,112	2022/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	820	766	21,294	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	702	696	19,344	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	900	25,004	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	630	17,506	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	351	9,770	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	500	501	13,929	2022/03/10
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750	747	20,763	2024/09/30
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	350	338	9,414	2027/11/16	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	850	841	23,387	2037/04/07	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,187	32,997	2025/03/14	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	500	498	13,848	2023/04/20	
通貨小計	銘柄数 金 額	34銘柄		29,271	28,925	803,553	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	千南アフリカ・ランド 5,768	千南アフリカ・ランド 5,746	47,237	2020/01/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	16,434	17,940	147,475	2026/12/21

2018年6月15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	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	千南アフリカ・ランド 7,612	千南アフリカ・ランド 5,440	千円 44,724	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	4,622	4,491	36,919	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	8,904	6,250	51,377	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	8,999	7,413	60,941	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	5,539	5,420	44,560	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	15,452	13,863	113,956	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	11,021	9,905	81,421	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	8,862	8,020	65,924	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	11,944	10,751	88,373	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	8,243	7,449	61,234	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	6,166	5,771	47,443	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	5,179	4,813	39,564	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金 額			124,745	113,279	931,156	
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	千ポーランド・ズロチ 2,630	78,503	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000	1,912	2,018	60,228	2019/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000	2,478	2,476	73,912	2020/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,377	3,233	96,481	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,127	2,137	63,780	2021/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	3,051	3,036	90,613	2021/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,370	2,245	67,007	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,320	2,325	69,381	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,700	1,707	50,956	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	300	289	8,652	2020/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,023	30,541	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	2,256	2,443	72,919	2020/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,084	1,215	36,271	2021/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,225	2,383	71,111	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	800	771	23,016	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,840	1,878	56,054	2019/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,591	2,638	78,720	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	17銘柄					
	金 額			33,567	34,455	1,028,153	
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国債証券	4.4000	千ユーロ 684	千ユーロ 717	91,739	2019/06/18
	IRISH TREASURY	国債証券	5.9000	570	618	79,138	2019/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,131	1,502	192,162	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	765	863	110,486	2020/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	504	597	76,421	2023/03/20
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	717	91,805	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	761	866	110,864	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	534	68,394	2022/03/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	681	713	91,270	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,101	140,891	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	350	357	45,709	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	—	50	50	6,408	2022/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	500	498	63,760	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	700	688	88,111	2033/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	4.5000	735	803	102,729	2020/04/18
国小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			9,627	10,632	1,359,894	
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	千ユーロ 548	千ユーロ 743	95,060	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,239	1,823	233,247	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,355	2,061	263,715	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	935	119,703	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,147	1,205	154,127	2019/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,146	1,245	159,278	2020/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,349	2,110	269,951	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,463	1,633	208,877	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,589	203,296	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,432	183,190	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,517	194,040	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,084	1,506	192,650	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,692	216,420	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,374	1,393	178,279	2020/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,291	1,293	165,445	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,338	1,354	173,202	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,215	155,469	2022/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,200	1,229	157,224	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	799	102,253	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	750	762	97,480	2028/07/15
国小計	銘柄数	20銘柄					
	金 額			23,580	27,544	3,522,916	

外国債券インデックスマザーファンド

2018年6月15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		
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,443	184,623	2025/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	924	919	117,565	2031/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	558	601	76,965	2038/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,283	1,333	170,497	2026/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,044	1,019	130,436	2047/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	340	359	45,932	2066/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	150	151	19,356	2023/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,400	1,417	181,359	2027/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	650	660	84,509	2024/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	260	285	36,531	2057/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	300	303	38,762	2037/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	600	600	76,865	2028/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	300	302	38,714	2033/04/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,491	318,627	2028/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,672	341,756	2035/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	877	1,021	130,639	2022/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	1,736	1,907	243,922	2020/09/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,674	2,562	327,806	2041/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,668	213,437	2021/09/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,314	168,177	2026/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,570	200,926	2022/09/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	680	939	120,099	2032/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	1,123	1,174	150,184	2019/09/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,494	191,205	2023/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	753	1,100	140,716	2045/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,724	220,598	2024/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	597	750	95,982	2034/06/22	
	国小計	銘柄数	27銘柄					
		金 額			26,664	31,792	4,066,199	
	ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	653	733	93,827	2019/10/25
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	8.5000	985	1,398	178,891	2023/04/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	6.0000	3,025	4,295	549,359	2025/10/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.5000	2,623	3,923	501,820	2029/04/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.7500	2,807	4,595	587,718	2032/10/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	2,209	3,435	439,381	2035/04/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	1,364	2,197	281,095	2055/04/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	3,230	3,618	462,835	2021/04/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	2,824	4,188	535,669	2038/10/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2500	3,697	4,546	581,553	2023/10/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.5000	3,084	4,947	632,778	2041/04/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	3,263	3,453	441,722	2019/10/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.5000	3,380	3,633	464,716	2020/04/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	1,167	1,925	246,262	2060/04/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.5000	3,146	3,916	500,874	2026/04/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	3,113	3,333	426,369	2020/10/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	3,550	3,983	509,488	2021/10/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.0000	3,630	4,093	523,574	2022/04/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	3,499	4,185	535,276	2027/10/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	2,694	2,982	381,448	2022/10/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	2,238	3,070	392,695	2045/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	3,347	3,650	466,908	2023/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	3,086	3,479	445,066	2024/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	2,787	3,299	421,952	2030/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	3,399	3,740	478,405	2024/11/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	2,322	2,358	301,590	2019/11/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	3,292	3,345	427,935	2025/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	—	3,070	3,101	396,689	2020/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	2,101	2,203	281,834	2025/11/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	2,193	2,232	285,583	2020/11/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	3,420	3,639	465,504	2031/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	2,737	2,754	352,337	2026/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2500	2,009	2,002	256,077	2036/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	787	763	97,601	2066/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	—	2,770	2,803	358,559	2021/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	2,800	2,743	350,850	2026/11/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	—	2,000	2,019	258,265	2022/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	620	661	84,597	2039/06/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	—	700	706	90,360	2020/02/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	2,500	2,591	331,475	2027/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,700	1,834	234,622	2048/05/25		
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,706	218,312	2023/03/25		
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,600	2,610	333,856	2028/05/25		
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,416	181,126	2021/02/25		
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	450	456	58,429	2034/05/25		
国小計	銘柄数	45銘柄						
	金 額			109,971	128,579	16,445,302		

2018年6月15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	
ユーロ (ドイツ)	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,319	168,723	2024/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,567	2,434	311,325	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,035	260,292	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,250	1,783	228,157	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,564	200,049	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,308	295,264	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	2,835	362,659	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,071	3,176	406,269	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	1,997	255,432	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,399	2,452	313,666	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,481	2,590	331,345	2019/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,075	2,203	281,793	2020/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,928	2,072	265,085	2020/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,474	2,175	278,286	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,444	1,536	196,564	2020/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,518	322,115	2021/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,867	238,900	2021/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,540	197,002	2021/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,807	3,051	390,242	2022/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,414	308,765	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,828	2,416	309,110	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,772	226,641	2022/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,526	195,251	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,971	252,096	2023/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,779	227,560	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,724	220,517	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,959	2,616	334,667	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,740	222,608	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,638	209,556	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,259	289,047	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,270	290,360	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,168	2,221	284,158	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	2,793	357,308	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,592	203,690	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,328	297,797	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	800	819	104,759	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,208	154,515	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	402	51,509	2019/06/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,901	2019/09/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,010	129,205	2019/12/13
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	707	90,540	2020/03/13	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	810	103,610	2020/06/12	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,151	1,165	149,061	2019/10/11	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,731	1,752	224,093	2020/04/17	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,448	1,477	188,917	2020/10/16	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,578	1,602	204,916	2021/04/09	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,421	181,873	2021/10/08	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	360	365	46,734	2022/04/08	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	2,127	272,076	2022/10/07	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	504	64,587	2023/04/14	
国小計	銘柄数	50銘柄					
	金額			77,343	90,004	11,511,621	
ユーロ (スペイン)	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,952	2,827	361,573	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,745	1,841	235,541	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,552	1,609	205,914	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,792	1,947	249,148	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1500	1,650	1,697	217,087	2020/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,853	237,019	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,747	1,792	229,248	2021/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,052	1,149	147,057	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	850	1,002	128,218	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,730	1,757	224,847	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	1,380	1,395	178,507	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,843	235,812	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,450	1,535	196,363	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,800	1,826	233,670	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	300	301	38,513	2021/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,000	1,010	129,280	2022/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,100	2,108	269,658	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	650	677	86,631	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	700	697	89,247	2023/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	2,980	381,194	2032/07/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,654	2,216	283,491	2037/01/31	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,608	2,368	302,884	2040/07/30	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	2,078	265,869	2024/01/31	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6000	1,882	1,987	254,182	2019/07/30	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3000	1,775	1,888	241,599	2019/10/31	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,373	1,979	253,147	2041/07/30	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,101	2,267	290,000	2020/04/30	

外国債券インデックスマザーファンド

2018年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	1,789	2,260	289,153	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,681	1,879	240,410	2020/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,515	2,918	373,338	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,703	345,760	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,393	306,131	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,608	3,222	412,157	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,601	1,935	247,554	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,404	307,582	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,499	2,311	295,681	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,333	298,467	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,369	303,048	2024/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	1,952	249,729	2020/01/31
国小計	銘柄数	39銘柄					
	金 額			64,410	75,330	9,634,728	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,500	191,950	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,499	191,723	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,129	400,217	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,848	236,476	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0500	1,445	1,453	185,944	2019/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,429	1,386	177,384	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,620	207,269	2022/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,598	204,456	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,765	1,512	193,457	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,511	1,509	193,019	2020/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,591	1,549	198,163	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,493	191,061	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	774	769	98,368	2020/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,440	1,267	162,106	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,359	2,272	290,688	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,286	1,206	154,307	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,674	1,644	210,325	2021/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	924	814	104,122	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,568	1,422	181,996	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	700	656	84,010	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,320	168,868	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	648	550	70,388	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	858	852	109,040	2019/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	700	645	82,582	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	2,010	1,939	248,034	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	295	37,828	2024/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	350	346	44,339	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	970	961	123,009	2020/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,450	1,432	183,210	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,000	947	121,245	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	700	681	87,136	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	700	668	85,557	2024/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	1,900	1,868	239,002	2020/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	800	759	97,119	2038/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	563	72,028	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	900	867	110,967	2023/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	900	849	108,711	2025/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	500	485	62,127	2021/04/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,454	2,989	382,330	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,721	475,998	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,655	2,153	275,403	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,921	2,037	260,639	2020/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,498	3,071	392,824	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,790	3,089	395,165	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	2,945	376,747	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,034	2,506	320,625	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,565	328,125	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,531	2,644	338,197	2019/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,472	316,220	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,043	2,516	321,921	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,560	2,712	346,935	2020/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,214	2,363	302,264	2020/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,363	302,231	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,296	293,750	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,532	323,965	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,265	289,758	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	1,912	244,645	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,910	2,211	282,793	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,810	2,105	269,339	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,129	272,421	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,613	1,947	249,087	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,477	316,839	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,729	1,856	237,450	2021/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,394	306,294	2024/09/01

2018年6月15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	3.5000	千ユーロ 1,938	千ユーロ 2,030	千円 259,755	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,638	209,598	2021/12/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	1.5000	1,246	1,261	161,293	2019/08/01
国小計	銘柄数	67銘柄					
	金 額			107,296	115,409	14,760,877	
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国債証券	0.3750	千ユーロ 432	千ユーロ 440	56,384	2020/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	407	52,156	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	290	37,127	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	411	414	52,954	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	200	25,601	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	270	272	34,884	2022/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	297	38,046	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	370	374	47,871	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.3750	416	437	56,014	2019/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	840	107,528	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	3.3750	632	677	86,712	2020/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	3.5000	459	510	65,300	2021/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	468	59,966	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	612	660	84,445	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	480	61,477	2023/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	529	67,762	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	588	75,231	2024/04/15
国小計	銘柄数	17銘柄					
	金 額			7,233	7,892	1,009,467	
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国債証券	0.2500	千ユーロ 527	千ユーロ 532	68,125	2019/10/18
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	926	118,538	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,148	146,907	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	734	733	93,810	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	150	132	16,999	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	—	900	901	115,283	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	580	575	73,670	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	250	270	34,591	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	403	51,627	2022/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	500	502	64,279	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,243	159,105	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.9000	1,248	1,363	174,438	2020/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,507	192,868	2021/09/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,073	1,603	205,027	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,178	150,739	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	917	117,399	2022/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	1,011	129,415	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	318	534	68,334	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	1.9500	138	141	18,092	2019/06/18
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	860	110,068	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,049	134,255	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	621	738	94,453	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,019	130,388	2024/10/21
国小計	銘柄数	23銘柄					
	金 額			16,658	19,299	2,468,421	
通貨小計	銘柄数	303銘柄					
	金 額			442,782	506,484	64,779,431	
合 計	銘柄数	772銘柄					
	金 額					161,781,211	

(注1) 邦貨換算金額は、2018年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第18期 (決算日 2017年11月30日)

(計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の公社債
運用方法	①主として外国の公社債に投資し、投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受け取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
株式組入制限	純資産総額の30%以下

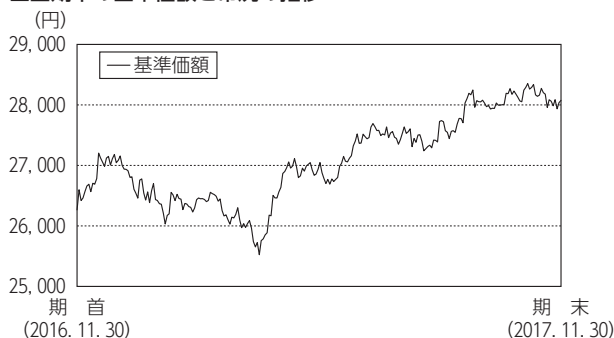
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年月日	基準価額		シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率
	円	%	騰落率 (ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2016年11月30日	26,265	—	26,597	—	98.4	—
12月末	27,085	3.1	27,285	2.6	98.6	—
2017年1月末	26,435	0.6	26,695	0.4	98.3	—
2月末	26,296	0.1	26,510	△ 0.3	98.4	—
3月末	26,300	0.1	26,423	△ 0.7	98.4	—
4月末	26,461	0.7	26,704	0.4	98.8	—
5月末	26,857	2.3	27,142	2.0	98.5	—
6月末	27,364	4.2	27,778	4.4	98.6	—
7月末	27,350	4.1	27,775	4.4	98.6	—
8月末	27,740	5.6	27,985	5.2	98.4	—
9月末	28,050	6.8	28,327	6.5	98.7	—
10月末	28,052	6.8	28,338	6.5	98.6	—
(期末) 2017年11月30日	28,075	6.9	28,323	6.5	98.4	—

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：26,265円 期末：28,075円 騰落率：6.9%

【基準価額の主な変動要因】

主に日本を除く先進国国債に投資した結果、債券市場で金利は上昇（債券価格は下落）したものの、ユーロなどの対円為替レートの上昇がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○海外債券市況

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

○為替相場

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））の騰落率は6.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は6.9%となりました。

当期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.05%程度でした。ただし、これらはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (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を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況
公 社 債

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

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

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

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

■ 主要な売買銘柄
公 社 債

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

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

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

■組入資産明細表

(1)外国(外貨建) 公社債(通貨別)

区 分	額 面 金 額	当 期			末				
		評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 比	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
アメリカ	千アメリカ・ドル 626,026	千アメリカ・ドル 632,164	千円 70,834,003	42.5%	—%	17.7%	16.6%	8.2%	
カナダ	千カナダ・ドル 37,381	千カナダ・ドル 40,103	3,492,978	2.1	—	0.9	0.7	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 38,134	千オーストラリア・ドル 41,065	3,485,224	2.1	—	1.3	0.5	0.2	
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,117	千シンガポール・ドル 7,446	619,502	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
イギリス	千イギリス・ポンド 60,444	千イギリス・ポンド 75,999	11,425,072	6.9	—	5.0	1.5	0.4	
スイス	千スイス・フラン 2,187	千スイス・フラン 2,587	294,510	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 48,636	千デンマーク・クローネ 60,118	1,072,508	0.6	—	0.4	0.1	0.1	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 32,577	千ノルウェー・クローネ 34,557	469,287	0.3	—	0.2	0.1	0.1	
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 50,850	千スウェーデン・クローネ 57,615	770,894	0.5	—	0.2	0.2	0.1	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 225,127	千メキシコ・ペソ 231,806	1,397,790	0.8	—	0.5	0.3	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 26,889	千マレーシア・リンギット 26,874	736,885	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 116,723	千南アフリカ・ランド 102,959	844,266	0.5	—	0.4	0.0	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 31,917	千ポーランド・ズロチ 32,731	1,034,302	0.6	—	0.2	0.3	0.1	
ユ ロ	アイルランド	千ユーロ 8,727	千ユーロ 9,950	1,321,550	0.8	—	0.5	0.2	0.1
	オランダ	千ユーロ 23,054	千ユーロ 27,284	3,623,622	2.2	—	1.4	0.6	0.2
	ベルギー	千ユーロ 26,235	千ユーロ 32,088	4,261,666	2.6	—	1.8	0.5	0.2
	フランス	千ユーロ 108,392	千ユーロ 128,181	17,023,784	10.2	—	6.4	2.6	1.3
	ドイツ	千ユーロ 76,126	千ユーロ 89,437	11,878,234	7.1	—	4.1	2.1	0.9
	スペイン	千ユーロ 61,672	千ユーロ 71,965	9,557,727	5.7	—	3.7	1.3	0.7
	イタリア	千ユーロ 107,051	千ユーロ 123,182	16,359,857	9.8	—	5.7	3.0	1.1
	フィンランド	千ユーロ 6,863	千ユーロ 7,614	1,011,296	0.6	—	0.4	0.2	0.0
	オーストリア	千ユーロ 16,667	千ユーロ 19,652	2,610,004	1.6	—	1.0	0.4	0.2
	小計	434,787	509,357	67,647,744	40.6	—	24.9	10.9	4.8
合 計	—	—	164,124,972	98.4	—	52.3	31.4	14.8	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国(外貨建) 公社債(銘柄別)

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

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末				償 還 年 月 日	
				額 面 金 額	評 価 額		外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額
					千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル			
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	559	555	62,231	2019/04/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,429	272,194	2022/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,385	2,364	264,908	2019/05/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,368	1,352	151,570	2019/06/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,784	1,759	197,108	2019/07/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,494	279,509	2022/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,872	1,848	207,085	2019/08/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,215	2,185	244,845	2019/09/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	884	875	98,115	2019/10/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,168	3,099	347,331	2022/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,353	1,332	149,358	2019/11/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,894	1,868	209,419	2019/12/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,366	1,354	151,762	2020/01/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,323	484,444	2023/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,968	1,944	217,894	2020/02/29		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,160	1,142	127,997	2020/03/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,589	514,245	2023/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,451	1,427	159,992	2020/04/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,461	2,434	272,790	2020/05/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,131	2,133	239,103	2020/06/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,827	2,839	318,124	2020/07/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,768	2,817	315,653	2023/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,993	2,008	225,006	2020/08/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,885	1,892	212,103	2020/09/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,611	3,598	403,188	2018/10/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,345	2,337	261,934	2020/10/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,179	580,403	2023/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,638	2,627	294,420	2018/11/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,501	2,510	281,307	2020/11/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,026	2,022	226,604	2018/12/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,006	2,035	228,107	2020/12/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,388	603,803	2024/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,185	2,180	244,273	2019/01/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,647	1,658	185,843	2021/01/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,373	2,367	265,291	2019/02/28		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,734	1,738	194,840	2021/02/28		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,383	2,380	266,700	2019/03/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,821	2,850	319,377	2021/03/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	5,412	5,495	615,789	2024/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,975	2,970	332,825	2019/04/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,407	2,430	272,379	2021/04/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,241	2,233	250,210	2019/05/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,732	2,736	306,668	2021/05/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,885	2,880	322,708	2019/06/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,485	3,504	392,688	2021/06/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.8750	904	982	110,144	2019/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.1250	724	801	89,815	2019/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.7500	642	759	85,151	2020/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,588	290,049	2021/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	798	89,442	2023/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,091	122,274	2026/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.5000	630	842	94,371	2026/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	944	105,829	2027/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	904	101,379	2028/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	939	105,291	2028/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	473	604	67,717	2029/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	964	1,358	152,192	2030/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	991	1,318	147,758	2031/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,626	2,088	234,032	2036/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	547	747	83,772	2037/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	696	78,083	2038/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	670	75,118	2038/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	849	961	107,720	2039/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,405	157,509	2039/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	760	985	110,412	2039/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,543	172,970	2039/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,710	2,254	252,649	2040/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,478	1,888	211,566	2040/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,591	1,898	212,727	2040/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,848	207,101	2040/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,754	2,360	264,539	2041/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,750	196,131	2041/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,367	1,603	179,701	2041/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,541	172,677	2041/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,723	193,150	2042/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,406	157,596	2042/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,731	1,719	192,668	2042/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,630	2,609	292,434	2042/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,026	2,148	240,686	2043/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,998	4,054	454,274	2043/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,064	3,531	395,701	2043/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	3,581	4,214	472,252	2043/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,617	4,175	467,816	2044/02/15		

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	期 末				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		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	3.3750	3,657	4,050	453,845	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,326	3,318	371,862	2019/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,861	320,674	2021/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,162	5,199	582,647	2024/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,729	3,955	443,259	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,989	2,982	334,143	2019/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,301	145,844	2021/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,404	3,403	381,357	2019/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,642	408,179	2021/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,190	3,174	355,663	2019/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,163	242,475	2021/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,921	3,917	438,970	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,696	3,832	429,472	2044/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,873	321,998	2021/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,325	4,302	482,096	2019/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,183	356,719	2021/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,204	2,196	246,165	2019/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,963	3,918	439,058	2020/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,427	2,376	266,291	2022/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,636	631,533	2025/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,763	3,535	396,176	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,788	2,762	309,502	2020/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,809	1,788	200,432	2022/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,792	2,764	309,787	2020/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,856	320,062	2022/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,722	641,249	2025/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,835	3,974	445,288	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,607	2,579	289,055	2020/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,578	288,969	2022/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,806	314,424	2022/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,013	2,988	334,915	2020/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,001	2,985	334,553	2020/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,828	316,883	2022/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,135	3,118	349,379	2020/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,172	243,412	2022/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,617	629,423	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,573	3,615	405,074	2045/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,422	271,455	2022/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,868	2,832	317,364	2020/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,433	272,702	2022/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,876	2,838	318,050	2020/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,809	650,943	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,116	3,072	344,291	2020/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	3,842	430,525	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,532	283,711	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,138	2,130	238,690	2018/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,073	344,357	2020/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,687	2,675	299,783	2022/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,151	2,142	240,012	2018/12/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	3,030	339,529	2020/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,492	2,494	279,465	2022/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,146	2,132	238,982	2019/01/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,126	3,075	344,576	2021/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,366	5,080	569,315	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,065	2,041	228,733	2019/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,515	281,823	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,428	3,213	360,039	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,100	2,080	233,161	2019/03/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,309	3,226	361,559	2021/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,262	2,192	245,615	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,936	329,041	2021/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	2,055	230,279	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,905	1,883	210,994	2019/04/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,029	5,695	638,232	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,404	269,394	2021/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,015	225,817	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	3,206	359,333	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,507	2,476	277,496	2019/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,647	296,647	2021/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,431	272,485	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,100	2,072	232,262	2019/06/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,428	272,071	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,876	322,307	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,460	275,690	2019/07/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,600	5,223	585,319	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	3,087	346,004	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,458	275,472	2019/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,585	401,757	2021/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,589	402,209	2021/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,644	296,288	2023/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,295	257,259	2023/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,600	2,559	286,764	2019/09/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,395	268,382	2023/09/30	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		外 貨 換 算 金 額	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	2,944	329,935	2021/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,147	2,117	237,215	2019/10/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,326	2,307	258,551	2018/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,500	5,337	598,027	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,915	326,720	2021/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,423	271,544	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,650	3,689	413,391	2046/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,400	1,379	154,582	2019/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,000	993	111,336	2018/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,481	278,067	2023/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,400	2,376	266,230	2021/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,440	1,428	160,072	2019/12/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,998	223,907	2021/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,400	1,393	156,164	2018/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,506	280,867	2023/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,500	1,487	166,663	2020/01/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,700	1,689	189,256	2019/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,040	3,996	447,833	2027/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,991	335,162	2022/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,484	278,381	2024/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,875	4,014	449,794	2047/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,130	2,110	236,501	2020/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,300	2,283	255,872	2019/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,989	335,004	2022/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,287	256,284	2024/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,900	1,892	212,054	2020/03/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,850	1,838	206,003	2019/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,250	4,224	473,307	2024/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	900	893	100,095	2022/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	850	843	94,557	2020/04/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,700	5,695	638,231	2027/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,700	2,796	313,380	2047/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	2,977	333,575	2022/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	2,958	331,447	2024/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	3,970	444,851	2020/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,960	331,709	2022/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,972	445,134	2019/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,971	220,913	2024/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,700	2,678	300,135	2020/06/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,969	444,784	2019/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,958	331,447	2022/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,363	264,864	2024/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,000	1,982	222,172	2020/07/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	994	111,388	2019/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,829	653,188	2027/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,300	1,288	144,384	2020/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,873	322,023	2022/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,977	333,575	2024/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,800	2,760	309,300	2047/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,100	2,057	230,523	2022/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	600	594	66,654	2019/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,953	218,880	2024/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	987	110,661	2020/09/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,475	277,410	2022/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	993	111,292	2019/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,371	377,724	2024/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,000	993	111,318	2020/10/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,490	279,029	2022/10/31	
通貨小計	銘柄数	244銘柄						
	金額			626,026	632,164	70,834,003		
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル			
	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	325	377	32,851	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	386	590	51,468	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,363	118,775	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,671	145,614	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,112	1,608	140,066	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,524	1,577	137,398	2019/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	1,799	156,773	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,876	1,969	171,541	2020/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	1,011	88,105	2021/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,838	160,152	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,561	1,965	171,169	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,241	108,156	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,471	128,173	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	853	857	74,693	2019/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,627	1,636	142,546	2019/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,197	1,335	116,279	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,194	104,020	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,719	1,720	149,874	2020/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,831	1,795	156,371	2020/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,129	1,099	95,807	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,237	1,206	105,111	2021/03/01	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利率	当 期 末			償 還 年 月 日
					額 面 金 額	評 価 額		
				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
通貨小計		銘柄数			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
		金 額						
		32銘柄						
				37,381	40,103	3,492,978		
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.2500	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル			
				2,455	2,566	217,823	2019/03/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,728	231,592	2021/05/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,409	2,560	217,289	2020/04/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,162	2,513	213,293	2022/07/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,420	205,411	2023/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,091	262,366	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,473	2,547	216,236	2024/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,314	1,403	119,109	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,398	2,548	216,254	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,358	1,655	140,512	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,848	3,249	275,769	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,011	2,049	173,919	2019/10/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	863	964	81,821	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	557	546	46,366	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,195	2,187	185,645	2020/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	712	734	62,330	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,142	2,195	186,305	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,978	1,931	163,937	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	932	891	75,647	2047/03/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	700	700	59,413	2021/12/21		
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,450	1,480	125,634	2028/11/21		
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	100	8,543	2022/11/21		
通貨小計	銘柄数	22銘柄						
	金 額			38,134	41,065	3,485,224		
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル			
				696	727	60,552	2020/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	862	71,716	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	465	38,732	2022/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.5000	599	608	50,613	2019/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	503	536	44,627	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	359	380	31,657	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	495	505	42,031	2021/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	413	34,357	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	491	514	42,815	2023/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	368	413	34,391	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	125	133	11,064	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	415	416	34,617	2019/10/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	124	127	10,573	2025/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	224	226	18,865	2020/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	318	331	27,569	2046/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	250	251	20,932	2026/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	190	187	15,572	2021/10/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	200	16,670	2022/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	150	145	12,142	2036/08/01	
通貨小計	銘柄数	19銘柄						
	金 額			7,117	7,446	619,502		
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド			
				2,280	2,365	355,567	2020/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,121	2,254	338,940	2025/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,543	382,305	2021/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,332	1,676	251,981	2065/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,495	224,759	2026/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	310	305	45,907	2022/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	460	419	63,031	2047/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	200	195	29,431	2037/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	600	599	90,107	2057/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	510	503	75,728	2027/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	500	493	74,211	2023/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,383	208,037	2021/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,394	209,657	2028/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,340	1,786	268,542	2032/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,873	281,676	2025/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,032	2,803	421,457	2036/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,457	2,188	328,940	2038/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,724	1,889	283,994	2020/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,878	432,698	2055/12/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,086	3,169	476,434	2046/12/07		
United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,565	235,397	2027/12/07		

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		外 貨 換 算 金 額	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,596	2,418	363,584	2042/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,480	2,033	305,654	2030/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,523	2,400	360,875	2049/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	873	917	137,890	2019/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,246	1,770	266,225	2039/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,572	236,384	2022/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,870	2,612	392,776	2034/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,428	1,510	227,012	2019/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,244	2,086	313,672	2060/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,795	1,952	293,512	2020/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,268	341,073	2040/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,633	1,820	273,624	2021/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,352	2,023	304,157	2052/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,338	351,613	2022/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,066	2,626	394,780	2044/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,942	2,083	313,185	2023/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,621	2,610	392,381	2068/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,251	2,296	345,204	2019/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,842	2,045	307,500	2024/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	2,828	425,149	2045/01/22	
通貨小計	銘柄数	41銘柄						
	金 額			60,444	75,999	11,425,072		
				千スイス・フラン	千スイス・フラン			
スイス	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	404	499	56,847	2023/02/11	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	497	707	80,495	2028/04/08	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	517	546	62,192	2019/05/12	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	407	439	49,990	2020/07/06	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	362	395	44,985	2021/04/28	
通貨小計	銘柄数	5銘柄						
	金 額			2,187	2,587	294,510		
				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ			
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	11,512	19,533	348,480	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	8,601	9,387	167,471	2019/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	8,050	9,132	162,929	2021/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,302	94,599	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	8,363	9,421	168,079	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,164	3,192	56,956	2018/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,600	2,613	46,620	2027/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,534	27,371	2020/11/15	
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金 額			48,636	60,118	1,072,508		
				千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ			
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	7,075	7,491	101,727	2019/05/22	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,998	7,691	104,457	2021/05/25	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	5,224	5,471	74,296	2023/05/24	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,539	61,651	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,495	47,475	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,365	45,709	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,450	2,501	33,970	2027/02/17	
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金 額			32,577	34,557	469,287		
				千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ			
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	9,095	10,614	142,025	2020/12/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	8,385	8,942	119,649	2019/03/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	5,723	76,575	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	9,892	132,365	2022/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,624	102,009	2023/11/13	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,095	5,930	79,353	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,680	5,932	79,371	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,950	2,955	39,543	2028/05/12	
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金 額			50,850	57,615	770,894		
				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ			
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.0000	21,447	20,619	124,333	2019/12/11	
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	13,290	12,099	72,959	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	4,000	4,204	25,352	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	10,633	11,084	66,838	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	22,119	25,601	154,377	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	10,668	10,846	65,406	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,874	8,599	51,857	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	8,844	9,655	58,221	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	22,092	22,379	134,947	2018/12/13	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	9,694	10,683	64,423	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	18,928	19,343	116,639	2020/06/11	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	27,826	27,312	164,691	2021/06/10	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	13,437	81,028	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	13,099	12,791	77,131	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	15,654	16,005	96,510	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	6,944	7,142	43,068	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金 額			225,127	231,806	1,397,790		

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期			末		償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額				
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円			
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7340	647	673	18,467	2019/07/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	573	537	14,738	2027/05/31		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.2480	738	787	21,605	2028/09/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	1,603	1,640	44,985	2019/11/29		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,174	32,196	2030/04/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,916	1,958	53,702	2021/07/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,533	42,047	2026/04/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	650	632	17,339	2031/06/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	861	23,610	2022/08/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	711	19,513	2027/03/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1270	618	595	16,315	2032/04/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,044	1,050	28,805	2020/03/31		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	982	26,928	2023/03/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	477	444	12,175	2033/04/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	586	558	15,308	2028/06/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8890	656	664	18,224	2020/07/31		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	601	16,494	2043/09/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,068	29,300	2024/07/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	857	869	23,836	2021/09/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6540	648	654	17,942	2019/10/31		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	737	729	20,002	2025/09/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	700	704	19,328	2020/10/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,160	31,826	2022/09/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	820	789	21,638	2035/05/31		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7590	768	776	21,289	2019/03/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	702	697	19,127	2023/08/17		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	910	24,957	2046/03/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	637	17,491	2026/11/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	352	9,662	2021/11/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	500	504	13,828	2022/03/10		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750	755	20,721	2024/09/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	350	348	9,549	2027/11/16		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	500	507	13,921	2037/04/07		
通貨小計	銘柄数	33銘柄							
	金額			26,889	26,874	736,885			
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	2,978	2,993	24,543	2018/12/21		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	5,768	5,682	46,600	2020/01/15		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	16,434	17,622	144,501	2026/12/21		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	7,612	5,229	42,882	2036/03/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	4,622	4,417	36,225	2021/03/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	8,904	6,007	49,261	2041/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	8,999	7,172	58,817	2031/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	5,539	5,340	43,789	2023/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	13,452	11,553	94,736	2048/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	11,021	9,479	77,733	2037/01/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	8,862	7,763	63,664	2030/01/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	7,944	6,818	55,909	2044/01/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	8,243	7,191	58,969	2032/03/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	4,166	3,752	30,774	2035/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	2,179	1,933	15,856	2040/01/31		
通貨小計	銘柄数	15銘柄							
	金額			116,723	102,959	844,266			
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	2,309	2,638	83,369	2022/09/23		
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000	1,912	2,053	64,884	2019/10/25		
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000	2,478	2,462	77,803	2020/04/25		
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,377	3,192	100,870	2026/07/25		
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,127	2,115	66,843	2021/04/25		
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	3,051	2,999	94,782	2021/07/25		
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,820	1,696	53,624	2027/07/25		
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,320	2,296	72,556	2022/04/25		
	Poland Government Bond	国債証券	—	400	392	12,392	2019/04/25		
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,300	1,290	40,786	2023/01/25		
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,033	32,674	2029/04/25		
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	2,256	2,466	77,948	2020/10/25		
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,084	1,224	38,683	2021/10/25		
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,225	2,367	74,813	2023/10/25		
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,840	1,893	59,841	2019/07/25		
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,591	2,608	82,428	2025/07/25		
通貨小計	銘柄数	16銘柄							
	金額			31,917	32,731	1,034,302			
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国債証券	4.4000	684	737	97,905	2019/06/18		
	IRISH TREASURY	国債証券	5.9000	570	640	85,009	2019/10/18		
	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,131	1,535	203,928	2025/03/13		
	IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	765	888	117,952	2020/10/18		
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	504	607	80,719	2023/03/20		
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	728	96,725	2024/03/18		
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	761	879	116,747	2030/05/15		
	IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	538	71,507	2022/03/15		
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	681	717	95,225	2045/02/18		

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,107	147,127	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	350	360	47,942	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	—	50	50	6,659	2022/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	4.5000	1,035	1,160	154,097	2020/04/18
国 小 計	銘柄数	13銘柄						
	金 額				8,727	9,950	1,321,550	
ユーロ (オランダ)		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	765	101,731	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,239	1,856	246,554	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,355	2,083	276,648	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	953	126,587	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,347	1,450	192,668	2019/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,146	1,270	168,762	2020/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,349	2,112	280,576	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,463	1,662	220,792	2021/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,609	213,694	2022/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,445	192,013	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,531	203,406	2023/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	924	944	125,475	2019/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,084	1,490	197,915	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,713	227,539	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,374	1,400	185,949	2020/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,291	1,297	172,278	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,338	1,357	180,258	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,218	161,762	2022/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	900	921	122,425	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	200	26,580	2024/01/15
国 小 計	銘柄数	20銘柄						
	金 額				23,054	27,284	3,623,622	
ユーロ (ベルギー)		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,453	193,015	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	924	927	123,177	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	558	614	81,666	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,283	1,344	178,512	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	744	738	98,049	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	190	204	27,220	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	150	151	20,177	2023/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,000	1,018	135,278	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	650	664	88,289	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	260	291	38,734	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	300	307	40,815	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,550	338,712	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,751	365,485	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	1,377	1,637	217,481	2022/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	821	871	115,748	2019/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	1,736	1,948	258,741	2020/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,674	2,636	350,109	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,706	226,674	2021/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,346	178,762	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,603	212,940	2022/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	680	958	127,351	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	1,123	1,197	159,002	2019/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,514	201,152	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	753	1,130	150,080	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,752	232,723	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	597	766	101,760	2034/06/22
国 小 計	銘柄数	26銘柄						
	金 額				26,235	32,088	4,261,666	
ユーロ (フランス)		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	653	767	101,965	2019/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	985	1,446	192,112	2023/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,225	3,239	430,266	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,623	3,994	530,494	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,807	4,658	618,732	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,709	4,254	565,056	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,075	3,288	436,802	2019/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,364	2,205	292,933	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,230	3,694	490,624	2021/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,824	4,216	560,014	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,697	4,641	616,497	2023/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,734	4,426	587,932	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,263	3,539	470,060	2019/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,380	3,712	493,087	2020/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,167	1,936	257,221	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,977	528,245	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,113	3,386	449,786	2020/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,550	4,054	538,491	2021/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,630	4,157	552,178	2022/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,499	4,227	561,443	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	3,016	400,653	2022/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,238	3,075	408,436	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,686	489,580	2023/05/25

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	千 円	邦 貨 換 算 金 額	
					千 ユーロ	千 ユーロ	千 円	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,920	1,951	259,228	2018/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,086	3,526	468,312	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,264	2,320	308,213	2019/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,787	3,322	441,301	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,799	3,112	413,332	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,322	2,374	315,363	2019/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,792	2,848	378,262	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,070	3,112	413,369	2020/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,101	2,217	294,528	2025/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,193	2,240	297,563	2020/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,720	2,902	385,442	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,592	1,605	213,264	2019/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,737	2,763	367,059	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,079	1,072	142,384	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	587	572	76,097	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,170	2,200	292,209	2021/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,354	312,719	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,021	268,422	2022/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	620	661	87,882	2039/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	709	94,167	2020/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,602	345,661	2027/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,000	1,077	143,045	2048/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	502	66,683	2023/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	500	501	66,652	2028/05/25	
国 小 計	銘柄数	47銘柄						
	金 額			108,392	128,181	17,023,784		
ユーロ (ドイツ)				千ユーロ	千ユーロ			
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,353	179,776	2024/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,567	2,481	329,605	2027/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,067	274,648	2028/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,371	182,159	2028/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,586	210,674	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,336	310,273	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	2,864	380,478	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,071	3,191	423,903	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	2,006	266,498	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,399	2,463	327,114	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	2,682	2,816	373,995	2019/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,481	2,650	352,009	2019/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,075	2,248	298,641	2020/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,928	2,112	280,534	2020/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,474	2,169	288,130	2042/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,444	1,560	207,198	2020/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,558	339,848	2021/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,903	252,760	2021/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,562	207,502	2021/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,807	3,089	410,342	2022/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,439	324,003	2022/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,728	2,272	301,777	2044/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,788	237,555	2022/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,540	204,531	2023/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,987	264,021	2023/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,798	238,889	2023/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,741	231,298	2024/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,959	2,599	345,238	2046/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,756	233,250	2024/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,649	219,046	2024/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,268	301,216	2025/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,283	303,303	2025/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,168	2,229	296,037	2026/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	2,793	370,964	2026/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,591	211,399	2027/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	700	707	93,949	2027/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	300	302	40,159	2048/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	950	957	127,135	2018/12/14	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,009	134,111	2019/03/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	404	53,754	2019/06/14	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	13,453	2019/09/13	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,438	1,469	195,161	2019/02/22	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,113	1,132	150,370	2019/04/12	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,151	1,171	155,652	2019/10/11	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,731	1,758	233,526	2020/04/17	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,448	1,484	197,128	2020/10/16	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,578	1,606	213,413	2021/04/09	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,425	189,284	2021/10/08	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	360	366	48,612	2022/04/08	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	405	53,890	2022/10/07	
国 小 計	銘柄数	50銘柄						
	金 額			76,126	89,437	11,878,234		
ユーロ (スペイン)				千ユーロ	千ユーロ			
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,952	2,820	374,609	2029/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,745	1,826	242,580	2025/04/30	

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	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,552	1,570	208,549	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,792	1,935	257,008	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1500	1,250	1,293	171,778	2020/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,835	243,794	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,672	1,683	223,643	2019/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,747	1,793	238,162	2021/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,052	1,083	143,900	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	550	598	79,501	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,730	1,734	230,317	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	580	584	77,636	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,818	241,532	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	550	564	74,974	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,295	172,038	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	300	300	39,943	2021/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	300	301	40,007	2022/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	2,934	389,741	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,654	2,143	284,630	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,608	2,279	302,736	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	2,102	279,174	2024/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6000	2,382	2,577	342,367	2019/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3000	1,775	1,932	256,659	2019/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,373	1,906	253,243	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,101	2,314	307,380	2020/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	1,789	2,271	301,636	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,681	1,923	255,491	2020/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,515	2,986	396,685	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,718	361,080	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,447	325,054	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,608	3,270	434,401	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,601	1,954	259,613	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,270	1,716	228,023	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,254	1,301	172,887	2018/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,049	1,543	205,057	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,836	1,916	254,577	2019/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,347	311,809	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,366	314,245	2024/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	1,967	261,249	2020/01/31
国 小 計	銘柄数	39銘柄					
	金 額			61,672	71,965	9,557,727	
ユ-ロ (イタリア)				千ユーロ	千ユーロ		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,622	215,456	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,633	216,910	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,425	454,897	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,970	261,761	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0500	1,445	1,482	196,955	2019/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,429	1,522	202,153	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,693	224,869	2022/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,704	226,434	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,765	1,644	218,394	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,511	1,541	204,749	2020/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,591	1,655	219,809	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,568	208,365	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	774	788	104,775	2020/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,440	1,371	182,202	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,359	2,388	317,265	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,286	1,290	171,343	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	812	817	108,506	2019/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,674	1,693	224,898	2021/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	924	884	117,507	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,568	1,520	201,919	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	700	690	91,730	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,363	181,077	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	448	405	53,828	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	858	863	114,665	2019/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	700	706	93,770	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,060	1,102	146,443	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	314	41,747	2024/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	350	361	48,036	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	120	121	16,116	2020/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	600	650	86,385	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,000	1,023	135,917	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	700	711	94,560	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	550	558	74,130	2024/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	100	100	13,357	2020/10/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,454	3,294	437,522	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,119	547,146	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,655	2,375	315,521	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,074	2,187	290,498	2019/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,921	2,118	281,355	2020/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,498	3,379	448,833	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,790	3,396	451,136	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	3,088	410,175	2021/08/01

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
						千 円	千 円	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,734	2,380	316,198	2039/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,745	364,647	2023/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,708	2,873	381,613	2019/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,531	2,734	363,127	2019/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,665	353,994	2025/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,043	2,784	369,788	2040/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,560	2,817	374,179	2020/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,214	2,461	326,915	2020/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,552	338,975	2026/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,399	318,623	2021/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,667	354,278	2021/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,404	319,339	2022/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	2,044	271,533	2022/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,910	2,365	314,151	2022/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,810	2,308	306,528	2028/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,270	301,543	2023/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,363	1,821	241,882	2044/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,655	352,710	2024/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,111	2,194	291,399	2018/12/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,729	1,942	257,964	2021/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.5000	1,100	1,144	152,019	2019/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,570	341,347	2024/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,938	2,230	296,271	2030/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,710	227,143	2021/12/15	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	1.5000	1,246	1,284	170,544	2019/08/01	
国 小 計	銘柄数	67銘柄						
	金 額			107,051	123,182	16,359,857		
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国債証券	0.3750	432	443	58,854	2020/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	410	54,535	2031/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	292	38,812	2025/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	411	416	55,296	2026/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	200	26,576	2023/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	—	270	273	36,293	2022/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	298	39,664	2027/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	4.3750	416	449	59,734	2019/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	857	113,846	2025/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	3.3750	632	691	91,892	2020/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	3.5000	459	520	69,149	2021/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	476	63,246	2028/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	612	666	88,529	2022/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	484	64,327	2023/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	539	71,660	2042/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	593	78,877	2024/04/15	
国 小 計	銘柄数	16銘柄						
	金 額			6,863	7,614	1,011,296		
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国債証券	0.2500	527	535	71,146	2019/10/18	
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	936	124,418	2025/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	926	950	126,301	2026/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	734	737	97,998	2047/02/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	150	131	17,529	2086/11/02	
	Austria Government Bond	国債証券	—	300	301	39,980	2023/07/15	
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	380	378	50,326	2027/04/20	
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	170	180	23,991	2117/09/20	
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	404	53,748	2022/09/20	
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,280	170,103	2027/07/15	
	Austria Government Bond	国債証券	3.9000	1,248	1,394	185,142	2020/07/15	
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,538	204,313	2021/09/15	
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,073	1,637	217,465	2037/03/15	
	Austria Government Bond	国債証券	4.3500	989	1,052	139,844	2019/03/15	
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,206	160,179	2026/03/15	
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	936	124,393	2022/04/20	
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	1,030	136,907	2022/11/22	
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	318	536	71,245	2062/01/26	
	Austria Government Bond	国債証券	1.9500	738	767	101,978	2019/06/18	
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	870	115,608	2044/06/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,061	141,037	2023/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	621	748	99,427	2034/05/23	
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,030	136,914	2024/10/21	
国 小 計	銘柄数	23銘柄						
	金 額			16,667	19,652	2,610,004		
通貨小計	銘柄数	301銘柄						
	金 額			434,787	509,357	67,647,744		
合 計	銘柄数	767銘柄						
	金 額					164,124,972		

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	164,124,972	98.4
コール・ローン等、その他	2,713,114	1.6
投資信託財産総額	166,838,087	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.05円、1カナダ・ドル=87.10円、1オーストラリア・ドル=84.87円、1シンガポール・ドル=83.19円、1イギリス・ポンド=150.33円、1スイス・フラン=113.83円、1デンマーク・クローネ=17.84円、1ノルウェー・クローネ=13.58円、1スウェーデン・クローネ=13.38円、1メキシコ・ペソ=6.03円、1マレーシア・リンギット=27.42円、1南アフリカ・ランド=8.20円、1ポーランド・ズロチ=31.60円、1ユーロ=132.81円です。
 (注3) 当期末における外貨建純資産(165,668,822千円)の投資信託財産総額(166,838,087千円)に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

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

*期首における元本額は59,006,131,580円、当期中における追加設定元本額は6,421,510,499円、同解約元本額は6,043,863,314円です。
 *当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスV A938,947,637円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)31,434,341円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)236,831,181円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)64,229,316円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)766,547,584円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)248,867,657円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)525,569,264円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)400,023,699円、D-I's 外国債券インデックス880,097円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 22,820円、iFree 外国債券インデックス575,119,716円、iFree 8資産バランス245,604,315円、DCダイワ外国債券インデックス40,005,557,043円、ダイワ・ライフ・バランス30 631,956,912円、ダイワ・ライフ・バランス50 299,143,351円、ダイワ・ライフ・バランス70 190,473,853円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)268,358,922円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)217,548,839円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)67,378,321円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 11,337,304円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 17,901,368円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 1,288,876円、ダイワ世界バランスファンド40VA497,823,550円、ダイワ世界バランスファンド60VA166,073,932円、ダイワ・バランスファンド35VA6,394,036,947円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA359,421,809円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA142,269,988円、ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)353,656,108円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券126,558,233円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド21,849,007円、ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)374,472円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,466,036,292円、ダイワライフスタイル25 34,455,585円、ダイワライフスタイル50 59,697,716円、ダイワライフスタイル75 16,502,710円です。
 *当期末の計算口数当りの純資産額は28,075円です。

■損益の状況

当期 自 2016年12月1日 至 2017年11月30日

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

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	無期限	
運用方針	海外の債券市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。	
主投資対象	ベビーファンド	イ. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券 ロ. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	新興国通貨建ての債券
ベビーファンドの運用方法	①主として、海外の債券指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の債券市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。 ②各マザーファンドの受益証券への投資にあたっては、下記の組入比率を目標に行ないます。 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の80% ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の20% ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。	
外国債券インデックスマザーファンドの運用方法	①主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。	
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの運用方法	①主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバースィファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 ②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	外国債券インデックスマザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の30%以下
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

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

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）

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2018年6月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）」は、このたび、第2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/>

<2733>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	円	税込み 分配金 円	期中 騰落率 %			
1 期末(2017年 6 月15日)	10,747	0	7.5	98.3	—	百万円 599
2 期末(2018年 6 月15日)	10,746	0	△ 0.0	98.1	—	1,195

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

(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。

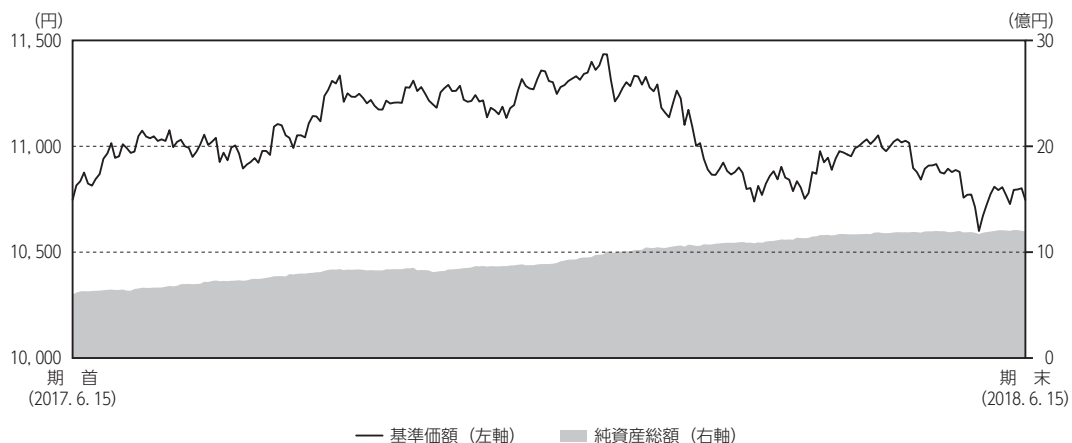
(注3) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

(注4) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



運用経過

基準価額等の推移について



■ 基準価額・騰落率

期首：10,747円

期末：10,746円

騰落率：△0.0%

■ 基準価額の主な変動要因

主に海外の債券に投資した結果、債券市場でおおむね金利が上昇(債券価格の下落)したものの、債券からの利息収入や、米ドルおよびユーロなどの対円為替レートの上昇がプラス要因となり、基準価額は期首と同程度の水準となりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

■ 組入ファンドの当期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国債券インデックスマザーファンド	1.2%	80.2%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	△2.9%	19.7%

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率		
(期首)2017年6月15日	10,747	—	98.3	—
6月末	10,945	1.8	97.8	—
7月末	10,950	1.9	97.9	—
8月末	11,105	3.3	98.0	—
9月末	11,233	4.5	98.3	—
10月末	11,182	4.0	98.1	—
11月末	11,195	4.2	98.0	—
12月末	11,361	5.7	97.3	—
2018年1月末	11,137	3.6	97.6	—
2月末	10,875	1.2	97.3	—
3月末	10,924	1.6	98.0	—
4月末	11,018	2.5	97.9	—
5月末	10,671	△ 0.7	97.8	—
(期末)2018年6月15日	10,746	△ 0.0	98.1	—

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■ 海外債券市況

海外の債券市場は、期を通して金利は上昇しました。

先進国では、期首より、ECB（欧州中央銀行）などが金融緩和姿勢を後退させる中で、ドイツなどを中心に金利は上昇しました。2017年8月には地政学リスクが意識され金利は低下しましたが、9月にFOMC（米国連邦公開市場委員会）で2017年内の追加利上げの可能性が示唆されたことなどから、金利は上昇しました。12月以降も、日本やユーロ圏などの主要先進国において金融政策の正常化観測が高まったことなどから、金利は上昇しました。2018年2月半ば以降は、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことを受けて市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、長期年限を中心に金利は低下傾向となりました。その後、金利は上昇しましたが、5月下旬にイタリアの政治不安を受けたりリスク回避姿勢の高まりから、再び低下しました。

新興国では、おおむね先進国と同様の動きとなりました。自国通貨防衛やインフレの抑制を目的として、複数の国で利上げが行なわれました。

■ 為替相場

為替相場は、期を通して、先進国通貨は対円で上昇しましたが新興国通貨は下落しました。

先進国では、期首より、ECBの金融緩和姿勢の後退がユーロなどの上昇要因となりました。2017年7月以降は、地政学リスクの高まりなどから円高傾向となりました。9月に入ると、FOMCで2017年内の追加利上げの可能性が示唆されたことなどから円安傾向となりました。その後、主要通貨はおおむね横ばいで推移しましたが、2018年に入ると、米国のムニューシン財務長官による米ドル安容認発言などから米ドルが下落しました。2月には、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことや各国の株価が急落したことなどから市場のリスク回避姿勢が強まり、円は上昇傾向となりました。4月以降は、米国金利が上昇したことなどから米ドルなどが上昇しました。一方、ユーロなどはイタリア情勢の影響から下落しました。

新興国では、米国金利の上昇や米ドル高の影響による新興国からの資金流出懸念、また自国の政治的な不透明感が嫌気されたことなどが通貨下落の要因となりました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマーク (J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)) に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

ポートフォリオについて

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳 (1万口当り)

項目	当 期	
	2017年6月16日 ~2018年6月15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)	745	

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2017. 6. 16~2018. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	47円	0.421%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,055円です。
(投信会社)	(32)	(0.292)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販売会社)	(12)	(0.108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 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
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	7	0.062	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(6)	(0.053)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	53	0.483	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券 インデックス・ マザーファンド	104,580	145,861	13,869	19,288
外国債券 インデックス マザーファンド	199,219	551,831	24,396	67,936

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期首		当期末	
	口数	千円	口数	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	88,958		179,670	235,709
外国債券インデックスマザーファンド	178,516		353,339	958,750

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	235,709	19.5%
外国債券インデックスマザーファンド	958,750	79.4%
コール・ローン等、その他	13,511	1.1%
投資信託財産総額	1,207,972	100.0%

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.68円、1カナダ・ドル=84.33円、1オーストラリア・ドル=82.53円、1シンガポール・ドル=82.20円、1イギリス・ポンド=146.66円、1スイス・フラン=110.92円、1トルコ・リラ=23.39円、1デンマーク・クローネ=17.17円、1ノルウェー・クローネ=13.60円、1スウェーデン・クローネ=12.64円、1メキシコ・ペソ=5.31円、1フィリピン・ペソ=2.08円、1アルゼンチン・ペソ=3.95円、100チリ・ペソ=17.40円、100コロンビア・ペソ=3.86円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1ブラジル・レアル=29.07円、1チェコ・コルナ=4.97円、1ルーマニア・レイ=27.43円、1ロシア・ルーブル=1.76円、1マレーシア・リンギット=27.78円、1南アフリカ・ランド=8.22円、1タイ・バーツ=3.42円、1ペルー・ソル=33.72円、1ポーランド・ズロチ=29.84円、100ハンガリー・フォリント=39.62円、1ウクライナ・ペソ=3.51円、1ユーロ=127.90円です。

(注3) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(8,953,548千円)の投資信託財産総額(9,047,889千円)に対する比率は、99.0%です。
外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(163,464,852千円)の投資信託財産総額(164,093,858千円)に対する比率は、99.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項目	当期末
(A) 資産	1,207,972,206円
コール・ローン等	5,629,919
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	235,709,566
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	958,750,954
未収入金	7,881,767
(B) 負債	12,439,341
未払解約金	10,076,705
未払信託報酬	2,318,103
その他未払費用	44,533
(C) 純資産総額(A-B)	1,195,532,865
元本	1,112,542,866
次期繰越損益金	82,989,999
(D) 受益権総口数	1,112,542,866口
1万口当り基準価額(C/D)	10,746円

*期首における元本額は557,544,250円、当期中における追加設定元本額は683,181,594円、同解約元本額は128,182,978円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,746円です。

<補足情報>

当ファンド(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))が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日(2017年11月30日)と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日(2018年6月15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掲載いたしました。180~192ページをご参照ください。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項目	当	期
(A) 配当等収益	△	1,093円
受取利息		55
支払利息	△	1,148
(B) 有価証券売買損益	△	17,693,559
売買益		2,601,227
売買損	△	20,294,786
(C) 信託報酬等	△	4,028,810
(D) 当期損益金(A+B+C)	△	21,723,462
(E) 前期繰越損益金		13,310,358
(F) 追加信託差損益金		91,403,103
(配当等相当額)	(17,802,111
(売買損益相当額)	(73,600,992
(G) 合計(D+E+F)		82,989,999
次期繰越損益金(G)		82,989,999
追加信託差損益金		91,403,103
(配当等相当額)	(17,802,111
(売買損益相当額)	(73,600,992
分配準備積立金		13,310,528
繰越損益金	△	21,723,632

(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いません。

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

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項目	当	期
(a) 経費控除後の配当等収益		0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		0
(c) 収益調整金		69,680,734
(d) 分配準備積立金		13,310,528
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)		82,991,262
(f) 分配金		0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)		82,991,262
(h) 受益権総口数		1,112,542,866口

《お知らせ》

■運用において参照している指数の名称変更について
当ファンドの主要投資対象である「外国債券インデックスマザーファンド」において参照している指数の名称を「シティ世界国債インデックス」から「FTSE世界国債インデックス」に変更しました。

★「外国債券インデックスマザーファンド」の第18期にかかる運用状況については193~206ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の決算日（2017年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15日）現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を213～217ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/7/1	181,723	Chile Government International Bond (チリ) 5.5% 2020/8/5	112,427
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2021/7/1	118,736	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/1/1	75,625
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2025/1/1	80,376	Thailand Government Bond (タイ) 3.875% 2019/6/13	68,280
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	79,454	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/4/1	58,048
Mexican Bonos (メキシコ) 6.5% 2022/6/9	76,842	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/10/1	41,060
Russian Federal Bond - OFZ (ロシア) 7.7% 2033/3/23	74,288	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/7/1	40,776
Mexican Bonos (メキシコ) 10% 2024/12/5	72,980	Mexican Bonos (メキシコ) 8.5% 2018/12/13	40,109
Colombian TES (コロンビア) 7.5% 2026/8/26	72,745	Poland Government Bond (ポーランド) 2018/10/25	38,774
BONOS TESORERIA PESOS (チリ) 5% 2035/3/1	70,798	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 7.875% 2019/4/15	31,229
Mexican Bonos (メキシコ) 6.5% 2021/6/10	68,353	Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2018/7/25	28,904

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

■組入資産明細表

下記は、2018年6月15日現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（6,882,755千円）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2018年6月15日現在							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちB格以下組入率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
トルコ	千トルコ・リラ 25,770	千トルコ・リラ 20,432	千円 477,920	% 5.3	% —	% 2.1	% 2.6	% 0.6
メキシコ	千メキシコ・ペソ 158,040	千メキシコ・ペソ 157,585	836,779	9.3	—	5.4	2.3	1.6
フィリピン	千フィリピン・ペソ 15,000	千フィリピン・ペソ 14,998	31,196	0.3	—	—	0.3	—
アルゼンチン	千アルゼンチン・ペソ 21,900	千アルゼンチン・ペソ 20,165	79,654	0.9	0.9	0.7	0.2	—
チリ	千チリ・ペソ 1,280,000	千チリ・ペソ 1,310,646	228,052	2.5	—	1.8	0.7	—
コロンビア	千コロンビア・ペソ 17,015,000	千コロンビア・ペソ 18,253,777	704,595	7.8	—	5.0	2.3	0.5
インドネシア	千インドネシア・ルピア 102,249,000	千インドネシア・ルピア 105,139,743	841,117	9.3	—	7.2	2.1	—
ブラジル	千ブラジル・レアル 34,400	千ブラジル・レアル 29,383	854,170	9.5	—	2.1	6.6	0.7
チェコ	千チェコ・コルナ 68,900	千チェコ・コルナ 71,867	357,182	4.0	—	2.3	1.2	0.4
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 8,210	千ルーマニア・レイ 8,273	226,945	2.5	—	0.8	1.3	0.5
ロシア	千ロシア・ルーブル 378,310	千ロシア・ルーブル 383,925	675,708	7.5	—	4.6	2.3	0.6
マレーシア	千マレーシア・リンギット 18,040	千マレーシア・リンギット 17,966	499,107	5.5	—	2.8	1.4	1.4
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 94,940	千南アフリカ・ランド 86,662	712,367	7.9	—	6.7	0.9	0.4
タイ	千タイ・バーツ 197,160	千タイ・バーツ 207,708	710,364	7.9	—	4.7	3.2	—
ペルー	千ペルー・ソル 7,210	千ペルー・ソル 7,785	262,526	2.9	—	2.8	0.1	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 26,640	千ポーランド・ズロチ 27,187	811,274	9.0	—	2.9	4.6	1.5
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 912,600	千ハンガリー・フォリント 978,154	387,544	4.3	—	2.1	2.1	0.1
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 5,100	千ウルグアイ・ペソ 4,812	16,891	0.2	—	0.1	0.1	—
合 計	—	—	8,713,400	96.5	0.9	54.0	34.2	8.3

(注1) 邦貨換算金額は、2018年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国(外貨建)公社債(銘柄別)

2018年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	千トルコ・リラ 680	千トルコ・リラ 612	千円 14,330	2020/01/15
	Turkey Government Bond	国債証券	9.5000	1,660	1,326	31,023	2022/01/12
	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	790	601	14,061	2022/09/14
	Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	1,280	902	21,107	2023/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	8.8000	1,390	1,038	24,286	2023/09/27
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	538	12,596	2024/03/20
	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	1,160	1,057	24,724	2019/07/10
	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,204	28,174	2024/07/24
	Turkey Government Bond	国債証券	7.4000	770	656	15,344	2020/02/05
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	1,490	1,008	23,594	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	9.4000	1,180	1,011	23,667	2020/07/08
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,610	1,366	31,971	2021/02/17
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	1,958	45,805	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国債証券	9.2000	1,010	807	18,898	2021/09/22
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	1,400	1,159	27,130	2022/03/02
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	1,470	1,134	26,543	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,900	1,551	36,286	2022/08/17
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	1,700	1,269	29,687	2027/08/11
	Turkey Government Bond	国債証券	12.2000	1,400	1,226	28,685	2023/01/18
通貨小計	銘柄数	19銘柄					
	金 額			25,770	20,432	477,920	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.0000	千メキシコ・ペソ 9,800	千メキシコ・ペソ 9,410	49,970	2019/12/11
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	10,400	9,086	48,249	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	4,500	4,485	23,819	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	4,250	4,254	22,591	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	18,350	20,272	107,649	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	10,230	9,942	52,792	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	8,813	46,801	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	7,230	7,521	39,940	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	4,100	4,302	22,844	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	16,990	17,050	90,540	2020/06/11
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	21,950	21,136	112,233	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,950	7,810	41,472	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	19,450	18,463	98,041	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	11,320	10,994	58,379	2042/11/13
Mexican Bonos	国債証券	7.7500	4,130	4,039	21,452	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			158,040	157,585	836,779	
フィリピン	Philippine Government International Bond	国債証券	4.9500	千フィリピン・ペソ 15,000	千フィリピン・ペソ 14,998	31,196	2021/01/15
通貨小計	銘柄数	1銘柄					
	金 額			15,000	14,998	31,196	
アルゼンチン	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	18.2000	千アルゼンチン・ペソ 4,700	千アルゼンチン・ペソ 4,235	16,728	2021/10/03
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	16.0000	9,400	8,696	34,350	2023/10/17
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	15.5000	7,800	7,234	28,575	2026/10/17
通貨小計	銘柄数	3銘柄					
	金 額			21,900	20,165	79,654	
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ 325,000	千チリ・ペソ 332,215	57,805	2021/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	370,000	369,267	64,252	2026/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	325,000	324,281	56,425	2035/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	210,000	232,890	40,522	2043/01/01
	Chile Government International Bond	国債証券	5.5000	50,000	51,992	9,046	2020/08/05
通貨小計	銘柄数	5銘柄					
	金 額			1,280,000	1,310,646	228,052	
コロンビア	Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	千コロンビア・ペソ 90,000	千コロンビア・ペソ 113,057	4,364	2027/06/28
	Colombia Government International Bond	国債証券	7.7500	95,000	100,415	3,876	2021/04/14
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	42,975	1,658	2023/03/21
	Colombian TES	国債証券	7.0000	1,235,000	1,269,086	48,986	2019/09/11
	Colombian TES	国債証券	11.0000	1,865,000	2,084,976	80,480	2020/07/24
	Colombian TES	国債証券	7.0000	2,935,000	3,075,293	118,706	2022/05/04
	Colombian TES	国債証券	10.0000	2,650,000	3,164,921	122,165	2024/07/24
	Colombian TES	国債証券	6.0000	1,290,000	1,238,696	47,813	2028/04/28
	Colombian TES	国債証券	7.5000	3,310,000	3,532,498	136,354	2026/08/26
	Colombian TES	国債証券	7.7500	1,700,000	1,835,422	70,847	2030/09/18
Colombian TES	国債証券	7.0000	1,800,000	1,796,436	69,342	2032/06/30	
通貨小計	銘柄数	11銘柄					
	金 額			17,015,000	18,253,777	704,595	

2018年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	5,750,000	5,943,890	47,551	2036/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	4,000,000	4,324,720	34,597	2031/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	2,800,000	2,746,408	21,971	2032/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	4,300,000	4,230,813	33,846	2038/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	2,400,000	2,623,488	20,987	2020/11/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	12.8000	1,600,000	1,855,712	14,845	2021/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	1,700,000	2,054,688	16,437	2025/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	2,180,000	2,673,203	21,385	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	7,210,000	7,474,030	59,792	2021/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	1,270,000	1,447,457	11,579	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	10,224,000	10,906,656	87,253	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	4,933,255	39,466	2032/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	7,330,000	7,199,892	57,599	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	6,160,000	6,176,077	49,408	2022/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	5,910,000	5,594,642	44,757	2023/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	8,700,000	8,014,701	64,117	2028/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	4,975,000	4,533,618	36,268	2033/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	6,020,000	6,312,451	50,499	2034/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	9,150,000	9,660,844	77,286	2024/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	5,820,000	6,433,195	51,465	2029/03/15
通貨小計	銘柄数	20銘柄					
	金 額			102,249,000	105,139,743	841,117	
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	3,030	3,012	87,564	2021/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	4,410	4,205	122,241	2023/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	3,990	3,670	106,705	2025/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	2,750	2,450	71,235	2027/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	500	436	12,678	2029/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	2,650	2,305	67,023	2020/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	9,640	7,950	231,106	2020/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	5,030	3,697	107,483	2021/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	2,400	1,655	48,132	2022/01/01
	通貨小計	銘柄数	9銘柄				
	金 額			34,400	29,383	854,170	
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.7500	6,500	6,899	34,291	2020/09/12
	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.8500	8,200	8,932	44,395	2021/09/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	10,600	10,995	54,647	2028/08/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	8,600	10,665	53,008	2024/05/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.5000	6,000	6,067	30,157	2019/10/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	5,200	5,916	29,405	2022/09/12
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	6,100	6,334	31,484	2025/09/17
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	4,900	4,551	22,620	2026/06/26
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	5,000	4,278	21,261	2030/05/15
	Czech Republic Government Bond	国債証券	—	1,900	1,883	9,361	2020/02/10
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	2,900	2,745	13,645	2023/10/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,596	12,903	2027/02/10
	通貨小計	銘柄数	12銘柄				
	金 額			68,900	71,867	357,182	
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	1,507	41,361	2023/04/26
	Romania Government Bond	国債証券	5.9500	940	987	27,074	2021/06/11
	Romania Government Bond	国債証券	5.7500	770	800	21,949	2020/04/29
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,147	31,466	2025/02/24
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	630	617	16,937	2021/03/22
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	700	743	20,400	2027/07/26
	Romania Government Bond	国債証券	2.2500	700	687	18,845	2020/02/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,044	28,639	2022/12/19
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	800	738	20,270	2024/04/29
	通貨小計	銘柄数	9銘柄				
	金 額			8,210	8,273	226,945	
ロシア	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	14,880	15,170	26,699	2021/04/14
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	31,760	33,213	58,454	2027/02/03
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	11,910	12,172	21,422	2022/07/20
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.8000	10,800	10,806	19,018	2019/12/11
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,400	14,446	25,425	2023/01/25
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	26,160	25,523	44,920	2028/01/19
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.4000	22,100	21,933	38,602	2020/05/27
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	24,300	24,390	42,927	2023/08/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	29,300	29,783	52,418	2021/08/18
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	24,000	26,040	45,830	2031/09/17
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	36,100	36,894	64,934	2026/09/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	29,000	29,530	51,974	2022/12/07

2018年6月15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	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	千ロシア・ルーブル 47,000	千ロシア・ルーブル 47,611	千円 83,796	2033/03/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	35,600	35,546	62,562	2024/10/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	15,000	15,039	26,468	2021/12/15
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	6,000	5,824	10,251	2024/02/28
通貨小計	銘柄数	16銘柄					
	金 額			378,310	383,925	675,708	
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.2260	千マレーシア・リンギット 530	千マレーシア・リンギット 525	14,595	2020/04/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.9480	800	800	22,228	2022/04/14
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,200	1,189	33,043	2027/07/26
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	1,570	1,589	44,157	2019/11/29
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,350	1,368	38,003	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,510	1,509	41,924	2020/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,746	48,505	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6540	910	912	25,356	2019/10/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,350	1,324	36,806	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	1,040	1,042	28,966	2020/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	900	892	24,800	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	800	775	21,546	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	1,200	1,199	33,308	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	920	916	25,470	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,120	1,084	30,125	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,100	1,089	30,266	2037/04/07
通貨小計	銘柄数	16銘柄					
	金 額			18,040	17,966	499,107	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	千南アフリカ・ランド 4,190	千南アフリカ・ランド 4,174	34,314	2020/01/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	12,550	13,700	112,620	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	5,220	3,731	30,670	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	3,760	3,653	30,034	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	5,280	3,706	30,466	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	8,440	6,953	57,156	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	5,880	5,754	47,303	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	11,520	10,335	84,958	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	8,000	7,190	59,103	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	7,100	6,425	52,817	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	8,100	7,290	59,931	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	5,300	4,789	39,371	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	5,100	4,773	39,241	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	4,500	4,182	34,377	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金 額			94,940	86,662	712,367	
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	千タイ・バーツ 19,050	千タイ・バーツ 22,659	77,494	2029/06/22
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	19,300	20,693	70,772	2023/06/16
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	16,610	18,212	62,285	2025/12/12
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	26,600	28,203	96,454	2021/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	15,700	16,717	57,175	2031/06/20
	Thailand Government Bond	国債証券	2.5500	18,200	18,512	63,312	2020/06/26
	Thailand Government Bond	国債証券	1.8750	21,200	21,163	72,380	2022/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	14,100	14,433	49,362	2036/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	15,400	14,880	50,890	2026/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	16,000	15,988	54,680	2022/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	15,000	16,244	55,554	2032/06/25
通貨小計	銘柄数	11銘柄					
	金 額			197,160	207,708	710,364	
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	千ペルー・ソル 1,130	千ペルー・ソル 1,173	39,583	2024/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	1,470	1,548	52,218	2028/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	950	974	32,865	2032/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	1,065	1,265	42,668	2026/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	7.8400	310	343	11,566	2020/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	1,165	1,245	41,999	2037/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	1,120	1,234	41,623	2031/08/12
通貨小計	銘柄数	7銘柄					
	金 額			7,210	7,785	262,526	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 2,210	千ポーランド・ズロチ 2,518	75,137	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000	880	928	27,720	2019/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000	2,210	2,209	65,918	2020/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,640	2,527	75,425	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	1,560	1,567	46,778	2021/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	2,230	2,219	66,230	2021/07/25

2018年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	千ポーランド・ズロチ 2,090	千ポーランド・ズロチ 1,980	千円 59,091	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	1,650	1,653	49,344	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,000	2,009	59,948	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	1,000	966	28,840	2020/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	920	996	29,736	2020/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,820	2,040	60,899	2021/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	1,530	1,638	48,899	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	800	771	23,016	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,250	1,276	38,080	2019/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,850	1,883	56,207	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	16銘柄					
	金 額			26,640	27,187	811,274	
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.5000	千ハンガリー・フォリント 66,300	千ハンガリー・フォリント 69,757	27,637	2020/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	98,500	101,147	40,074	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	128,000	125,200	49,604	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	23,000	23,460	9,294	2019/10/30
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	39,000	40,200	15,927	2021/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	14,000	14,057	5,569	2020/09/23
	Hungary Government Bond	国債証券	1.7500	90,000	89,613	35,504	2022/10/26
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	40,000	38,880	15,404	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	0.5000	60,000	58,684	23,250	2021/04/21
	Hungary Government Bond	国債証券	7.5000	99,500	114,748	45,463	2020/11/12
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	81,800	97,533	38,642	2023/11/24
	Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	80,000	96,069	38,062	2022/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	92,500	108,803	43,107	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	13銘柄					
	金 額			912,600	978,154	387,544	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	9.8750	千ウルグアイ・ペソ 2,300	千ウルグアイ・ペソ 2,309	8,107	2022/06/20
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,800	2,502	8,783	2028/03/15
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金 額			5,100	4,812	16,891	
合 計	銘柄数	199銘柄					
	金 額					8,713,400	

(注1) 邦貨換算金額は、2018年6月15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。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

運用報告書 第7期 (決算日 2017年7月5日)

(計算期間 2016年7月6日～2017年7月5日)

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの第7期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をJ Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (円換算)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	新興国通貨建ての債券
運用方法	①主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をJ Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (円換算)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 ②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
株式組入制限	純資産総額の10%以下

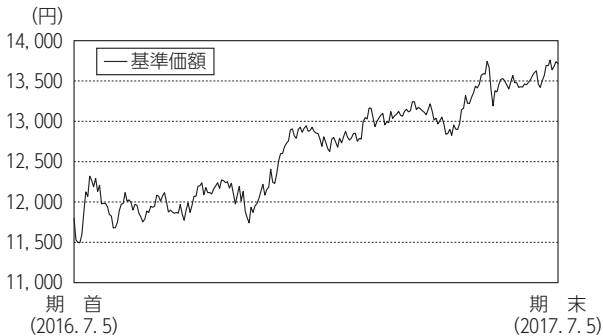
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



《運用経過》

【基準価額・騰落率】

期首：11,798円 期末：13,715円 騰落率：△16.2%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券の利息収入および新興国通貨の対円為替レートの上昇がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○新興国債券市況

新興国債券市況は、個別国要因でまちまちの展開となりました。

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

○為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

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

◆前期における「今後の運用方針」

今後もファンドの通貨の比率をベンチマーク (J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (円換算)) に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

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

年月日	基準価額	騰落率		J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (円換算) (ベンチマーク)		騰落率	騰落率	公社債組入比率
		円	%	円	%			
(期首) 2016年7月5日	11,798	—	—	12,413	—	—	—	97.3
7月末	11,941	1.2	1.2	12,582	1.4	1.4	1.4	97.5
8月末	11,945	1.2	1.2	12,579	1.3	1.3	1.3	97.5
9月末	11,870	0.6	0.6	12,563	1.2	1.2	1.2	97.8
10月末	12,172	3.2	3.2	12,859	3.6	3.6	3.6	97.2
11月末	12,184	3.3	3.3	12,815	3.2	3.2	3.2	97.4
12月末	12,886	9.2	9.2	13,572	9.3	9.3	9.3	94.7
2017年1月末	12,805	8.5	8.5	13,524	9.0	9.0	9.0	96.3
2月末	12,997	10.2	10.2	13,743	10.7	10.7	10.7	96.7
3月末	13,217	12.0	12.0	14,083	13.5	13.5	13.5	97.2
4月末	13,220	12.1	12.1	13,972	12.6	12.6	12.6	97.1
5月末	13,400	13.6	13.6	14,174	14.2	14.2	14.2	95.7
6月末	13,638	15.6	15.6	14,459	16.5	16.5	16.5	95.1
(期末) 2017年7月5日	13,715	16.2	16.2	14,485	16.7	16.7	16.7	97.1

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (円換算) は、J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (米ドルベース) は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。

■ 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	27
（保管費用）	(26)
（その他）	(1)
合 計	27

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

(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2016年7月6日から2017年7月5日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

公 社 債

(2016年7月6日から2017年7月5日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国 (外貨建) 公社債 (通貨別)

作成期 区分	当 期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
トルコ	千トルコ・リラ 14,460	千トルコ・リラ 13,888	千円 441,499	7.7%	—%	3.5%	3.5%	0.6%
メキシコ	千メキシコ・ペソ 85,590	千メキシコ・ペソ 89,842	558,820	9.7	—	5.5	3.4	0.8
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 10,350	23,184	0.4	—	—	0.4	—
アルゼンチン	千アルゼンチン・ペソ 8,500	千アルゼンチン・ペソ 9,302	62,231	1.1	1.1	0.7	0.4	—
チリ	千チリ・ペソ 590,000	千チリ・ペソ 627,866	106,988	1.9	—	—	1.9	—
コロンビア	千コロンビア・ペソ 10,015,000	千コロンビア・ペソ 10,886,796	403,900	7.0	—	3.9	2.7	0.3
インドネシア	千インドネシア・ルピア 60,849,000	千インドネシア・ルピア 65,247,366	554,602	9.6	—	7.2	1.8	0.6
ブラジル	千ブラジル・レアル 19,050	千ブラジル・レアル 16,963	579,459	10.0	—	3.0	3.4	3.7
チェコ	千チェコ・コルナ 33,900	千チェコ・コルナ 38,627	189,658	3.3	—	2.1	1.2	—
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 4,940	千ルーマニア・レイ 5,325	149,223	2.6	—	1.0	1.1	0.6
ロシア	千ロシア・ルーブル 187,240	千ロシア・ルーブル 186,413	356,049	6.2	—	3.9	1.5	0.7
マレーシア	千マレーシア・リンギット 14,180	千マレーシア・リンギット 14,134	371,877	6.4	—	3.3	2.7	0.4
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 60,910	千南アフリカ・ランド 55,645	476,327	8.3	—	7.3	0.7	0.2
タイ	千タイ・バーツ 119,960	千タイ・バーツ 128,345	426,105	7.4	—	3.4	2.7	1.3
ペルー	千ペルー・ソル 3,430	千ペルー・ソル 3,775	131,046	2.3	—	2.1	0.2	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 17,190	千ポーランド・ズロチ 17,382	526,876	9.1	—	3.6	4.5	1.1
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 521,400	千ハンガリー・フォリント 594,117	247,568	4.3	—	1.7	2.0	0.7
合計	—	—	5,605,421	97.1	1.1	52.2	34.1	10.9

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区分	銘柄	種類	年利率	当 期			末		償還年月日
				額面金額	評 価 額				
					外貨建金額	邦貨換算金額			
			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円			
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	3,300	3,731	23,212	2038/11/18		
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	6,590	6,832	42,498	2020/06/11		
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	9,950	9,904	61,608	2021/06/10		
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	4,950	5,266	32,759	2031/05/29		
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	5,450	5,415	33,681	2022/06/09		
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,820	8,194	50,972	2042/11/13		
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	2,180	2,325	14,466	2034/11/23		
通貨小計	銘柄数 金額	16銘柄		85,590	89,842	558,820			
			%	千フィリピン・ペソ	千フィリピン・ペソ	千円			
フィリピン	Philippine Government International Bond	国債証券	4.9500	10,000	10,350	23,184	2021/01/15		
通貨小計	銘柄数 金額	1銘柄		10,000	10,350	23,184			
			%	千アルゼンチン・ペソ	千アルゼンチン・ペソ	千円			
アルゼンチン	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	18.2000	3,100	3,309	22,138	2021/10/03		
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	16.0000	1,400	1,509	10,095	2023/10/17		
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	15.5000	4,000	4,483	29,997	2026/10/17		
通貨小計	銘柄数 金額	3銘柄		8,500	9,302	62,231			
			%	千チリ・ペソ	千チリ・ペソ	千円			
チリ	Chile Government International Bond	国債証券	5.5000	590,000	627,866	106,988	2020/08/05		
通貨小計	銘柄数 金額	1銘柄		590,000	627,866	106,988			
			%	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ	千円			
コロンビア	Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	90,000	115,672	4,291	2027/06/28		
	Colombia Government International Bond	国債証券	7.7500	95,000	102,301	3,795	2021/04/14		
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	42,086	1,561	2023/03/21		
	Colombian TES	国債証券	5.0000	520,000	522,147	19,371	2018/11/21		
	Colombian TES	国債証券	7.0000	735,000	761,731	28,260	2019/09/11		
	Colombian TES	国債証券	11.0000	1,465,000	1,694,008	62,847	2020/07/24		
	Colombian TES	国債証券	7.0000	1,625,000	1,704,966	63,254	2022/05/04		
	Colombian TES	国債証券	10.0000	1,650,000	2,011,861	74,640	2024/07/24		
	Colombian TES	国債証券	6.0000	940,000	897,596	33,300	2028/04/28		
	Colombian TES	国債証券	7.5000	1,530,000	1,631,729	60,537	2026/08/26		
	Colombian TES	国債証券	7.7500	940,000	1,020,811	37,872	2030/09/18		
	Colombian TES	国債証券	7.0000	380,000	381,881	14,167	2032/06/30		
通貨小計	銘柄数 金額	12銘柄		10,015,000	10,886,796	403,900			
			%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円			
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,047,587	42,904	2036/05/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	4,000,000	4,486,200	38,132	2031/05/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	2,400,000	2,710,488	23,039	2020/11/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	12.8000	600,000	726,318	6,173	2021/06/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	1,000,000	1,246,910	10,598	2025/09/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	980,000	1,234,280	10,491	2030/08/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	5,710,000	6,016,569	51,140	2021/07/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	1,270,000	1,499,997	12,749	2031/07/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	5,524,000	6,088,276	51,750	2026/09/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	3,350,000	3,584,701	30,469	2032/06/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	4,230,000	4,282,071	36,397	2027/05/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	2,560,000	2,591,334	22,026	2022/05/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	1,410,000	1,330,673	11,310	2023/05/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	1,200,000	1,103,292	9,377	2028/05/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	1,975,000	1,808,152	15,369	2033/05/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	4,720,000	5,065,220	43,054	2034/03/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	6,350,000	6,859,714	58,307	2024/03/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	4,920,000	5,572,096	47,362	2029/03/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.8750	3,900,000	3,993,483	33,944	2019/04/15		
通貨小計	銘柄数 金額	19銘柄		60,849,000	65,247,366	554,602			
			%	千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル	千円			
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	1,880	1,888	64,504	2021/01/01		
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	2,330	2,308	78,841	2023/01/01		
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	280	284	9,728	2019/01/01		
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	1,390	1,360	46,458	2025/01/01		
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	1,380	1,340	45,792	2027/01/01		
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	2,370	2,089	71,392	2019/01/01		
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,510	1,269	43,375	2019/07/01		
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,580	1,261	43,087	2020/01/01		
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,270	1,145	39,141	2018/10/01		
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	3,340	2,531	86,469	2020/07/01		
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,720	1,483	50,668	2019/04/01		
通貨小計	銘柄数 金額	11銘柄		19,050	16,963	579,459			

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
					額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
					千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ	千円	
チェコ		Czech Republic Government Bond	国債証券	3.7500	3,500	3,921	19,253	2020/09/12
		Czech Republic Government Bond	国債証券	3.8500	3,300	3,832	18,817	2021/09/29
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	3,100	3,535	17,357	2028/08/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	5,600	7,678	37,700	2024/05/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.5000	6,000	6,226	30,572	2019/10/29
		Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	3,000	3,718	18,257	2022/09/12
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	3,100	3,501	17,192	2025/09/17
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	3,200	3,230	15,860	2026/06/26
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	3,100	2,983	14,647	2030/05/15
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金 額			33,900	38,627	189,658		
ルーマニア		Romania Government Bond	国債証券	5.8500	430	493	13,831	2023/04/26
		Romania Government Bond	国債証券	4.7500	360	383	10,747	2019/06/24
		Romania Government Bond	国債証券	5.6000	420	447	12,533	2018/11/28
		Romania Government Bond	国債証券	5.9500	440	497	13,946	2021/06/11
		Romania Government Bond	国債証券	5.7500	770	852	23,895	2020/04/29
		Romania Government Bond	国債証券	4.7500	580	624	17,511	2025/02/24
		Romania Government Bond	国債証券	2.5000	360	367	10,311	2019/04/29
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	430	443	12,428	2021/03/22
		Romania Government Bond	国債証券	5.8000	300	346	9,698	2027/07/26
		Romania Government Bond	国債証券	2.2500	370	374	10,503	2020/02/26
		Romania Government Bond	国債証券	3.5000	480	493	13,815	2022/12/19
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金 額			4,940	5,325	149,223		
ロシア		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	7,880	7,824	14,945	2021/04/14
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	7,130	7,106	13,573	2019/02/27
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	18,760	19,584	37,405	2027/02/03
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	11,910	11,844	22,622	2022/07/20
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.8000	6,500	6,363	12,154	2019/12/11
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	8,400	8,101	15,474	2023/01/25
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	11,660	11,111	21,222	2028/01/19
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.4000	14,100	13,651	26,074	2020/05/27
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.7000	15,700	15,464	29,537	2019/05/15
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,300	13,838	26,432	2023/08/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	18,300	18,111	34,593	2021/08/18
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	16,300	17,343	33,125	2031/09/17
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	15,300	15,362	29,342	2026/09/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	10,000	9,880	18,870	2022/12/07
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	11,000	10,824	20,673	2033/03/23	
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金 額			187,240	186,413	356,049		
マレーシア		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3900	600	610	16,069	2023/07/07
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0700	870	861	22,654	2026/09/30
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7430	280	279	7,343	2021/08/26
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.2260	530	524	13,800	2020/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	970	988	26,002	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	920	932	24,530	2021/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	670	651	17,147	2031/06/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5800	510	511	13,460	2018/09/28
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	440	431	11,339	2022/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	540	538	14,171	2020/03/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	860	837	22,036	2023/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	740	748	19,689	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	650	656	17,279	2021/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6540	910	913	24,033	2019/10/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	660	654	17,210	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	590	590	15,529	2020/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	590	589	15,520	2022/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	570	551	14,504	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7590	380	382	10,054	2019/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	500	494	13,010	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	800	790	20,787	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	600	596	15,699	2021/11/30	
通貨小計	銘柄数	22銘柄						
	金 額			14,180	14,134	371,877		
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	1,120	1,127	9,654	2018/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	2,590	2,567	21,981	2020/01/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	8,450	9,379	80,291	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	3,220	2,282	19,535	2036/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	2,560	2,476	21,200	2021/03/31

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	期 末			償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	4,280	3,002	25,698	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	4,240	3,478	29,773	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	2,980	2,924	25,031	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	7,320	6,576	56,296	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	8,350	7,468	63,929	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	5,700	5,166	44,223	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	3,200	2,869	24,566	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	3,800	3,438	29,430	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	2,100	1,961	16,786	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	1,000	926	7,928	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			60,910	55,645	476,327	
			%	千タイ・バーツ	千タイ・バーツ	千円	
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	3.8750	18,300	19,115	63,465	2019/06/13
	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	12,950	15,805	52,472	2029/06/22
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	11,500	12,451	41,339	2023/06/16
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	11,310	12,570	41,733	2025/12/12
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	19,600	21,138	70,179	2021/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4500	2,800	2,888	9,591	2019/03/08
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	5,500	5,968	19,815	2031/06/20
	Thailand Government Bond	国債証券	2.5500	12,000	12,335	40,953	2020/06/26
	Thailand Government Bond	国債証券	1.8750	13,500	13,472	44,728	2022/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	5,100	5,400	17,928	2036/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	7,400	7,197	23,897	2026/12/17
通貨小計	銘柄数	11銘柄					
	金 額			119,960	128,345	426,105	
			%	千ペルー・ソル	千ペルー・ソル	千円	
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	580	604	20,968	2024/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	770	819	28,455	2028/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	535	641	22,269	2026/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	7.8400	310	345	11,978	2020/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	465	510	17,722	2037/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	770	854	29,652	2031/08/12
通貨小計	銘柄数	6銘柄					
	金 額			3,430	3,775	131,046	
			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,210	1,390	42,158	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000	880	949	28,790	2019/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000	1,210	1,193	36,168	2020/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,740	1,650	50,015	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	1,560	1,541	46,720	2021/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	1,270	1,243	37,696	2018/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	1,130	1,102	33,407	2021/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,140	1,064	32,265	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	1,650	1,624	49,251	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	830	802	24,329	2019/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	620	680	20,624	2020/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	570	647	19,621	2021/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	1,030	1,100	33,359	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	810	833	25,258	2019/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,540	1,557	47,208	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			17,190	17,382	526,876	
			%	千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント	千円	
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.5000	66,300	72,000	30,002	2020/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	55,500	57,657	24,026	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	23,000	22,969	9,571	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	23,000	23,907	9,962	2019/10/30
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	39,000	40,959	17,067	2021/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	7.5000	44,500	54,323	22,636	2020/11/12
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	61,800	75,902	31,628	2023/11/24
	Hungary Government Bond	国債証券	6.5000	58,800	66,123	27,553	2019/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	63,000	79,318	33,051	2022/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	24,000	25,902	10,793	2018/12/20
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	62,500	75,053	31,274	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	11銘柄					
	金 額			521,400	594,117	247,568	
合 計	銘柄数	196銘柄					
	金 額					5,605,421	

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

■投資信託財産の構成

2017年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	5,605,421 千円	92.9 %
コール・ローン等、その他	430,170	7.1
投資信託財産総額	6,035,591	100.0

- (注1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.08円、1トルコ・リラ=31.79円、1メキシコ・ペソ=6.22円、1フィリピン・ペソ=2.24円、1アルゼンチン・ペソ=6.69円、100チリ・ペソ=17.04円、100コロンビア・ペソ=3.71円、100インドネシア・ルピア=0.85円、1ブラジル・レアル=34.16円、1チェコ・コルナ=4.91円、1ルーマニア・レイ=28.02円、1ロシア・ルーブル=1.91円、1マレーシア・リンギット=26.31円、1南アフリカ・ランド=8.56円、1タイ・バーツ=3.32円、1ペルー・ソル=34.71円、1ポーランド・ズロチ=30.31円、100ハンガリー・フォリント=41.67円です。
 (注3) 当期末における外貨建純資産(5,615,457千円)の投資信託財産総額(6,035,591千円)に対する比率は、93.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年7月5日現在

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

- *期首における元本額は2,923,660,797円、当期中における追加設定元本額は1,904,435,637円、同解約元本額は620,605,669円です。
 *当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし) 92,883,266円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし) 100,049,168円、D-I's 新興国債券インデックス31,709,295円、iFree 新興国債券インデックス464,867,850円、iFree 8資産バランス325,557,701円、D C ダイワ新興国債券インデックスファンド 2,999,269,705円、ダイワ・インデックスセレクト新興国債券174,677,461円、ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド18,476,319円です。
 *当期末の計算口数当りの純資産額は13,715円です。

■損益の状況

当期 自2016年7月6日 至2017年7月5日

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

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

ダイワファンドラップ J-REITインデックス

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／不動産投信（リート）／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果を東証REIT指数（配当込み、以下同じ。）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主投資対象	ベビーファンド	ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
	ダイワJ-REITマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）
マザーファンドの運用方法	①東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 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。	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率 マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	無制限
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

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

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2018年6月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ J-REITインデックス」は、このたび、第2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/>

<4640>

設定以来の運用実績

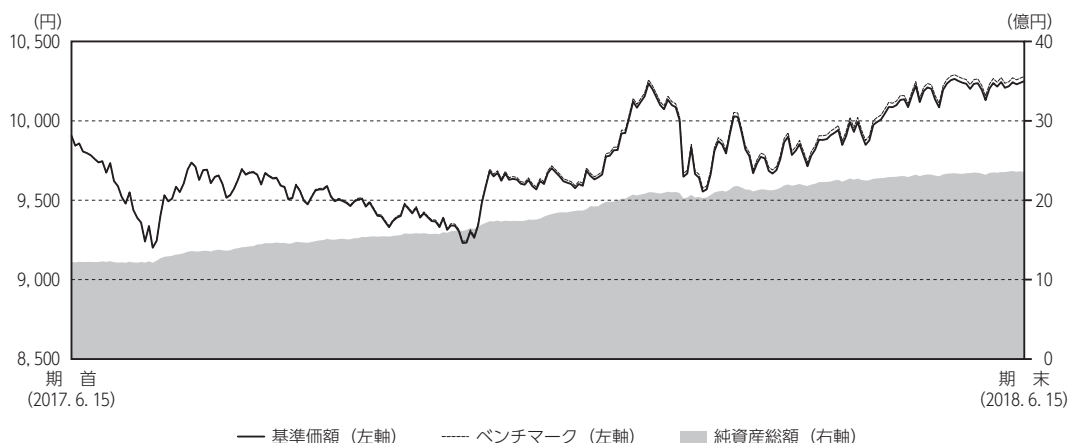
決算期	基準価額			東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数先 物率	純資産 総額
	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率				
1 期末 (2017年 6月15日)	円 9,906	円 0	% △ 0.9	3,274.94	% △ 0.7	% 98.3	% 1.4	百万円 1,224
2 期末 (2018年 6月15日)	円 10,250	円 0	% 3.5	3,398.25	% 3.8	% 98.3	% 1.5	百万円 2,355

(注1) 投資信託証券および不動産投信指数先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
 (注2) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

■ 基準価額・騰落率

期 首：9,906円
 期 末：10,250円
 騰落率：3.5%

■ 基準価額の主な変動要因

東証REIT指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざした運用を行なった結果、国内リート市況が上昇したことを反映して、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指数先物 比 率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
		%		%	%	%
(期首)2017年6月15日	9,906	—	3,274.94	—	98.3	1.4
6月末	9,621	△ 2.9	3,180.48	△ 2.9	98.2	1.4
7月末	9,737	△ 1.7	3,220.02	△ 1.7	98.1	1.4
8月末	9,640	△ 2.7	3,188.63	△ 2.6	98.2	1.5
9月末	9,490	△ 4.2	3,139.87	△ 4.1	98.0	1.5
10月末	9,366	△ 5.5	3,099.44	△ 5.4	98.1	1.6
11月末	9,635	△ 2.7	3,189.89	△ 2.6	98.0	1.6
12月末	9,631	△ 2.8	3,189.59	△ 2.6	98.2	1.4
2018年1月末	10,133	2.3	3,357.09	2.5	98.1	1.4
2月末	9,932	0.3	3,291.44	0.5	97.8	1.5
3月末	9,880	△ 0.3	3,274.92	△ 0.0	97.8	1.6
4月末	10,132	2.3	3,358.59	2.6	97.8	1.6
5月末	10,195	2.9	3,379.45	3.2	98.0	1.6
(期末)2018年6月15日	10,250	3.5	3,398.25	3.8	98.3	1.5

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

国内リート市況

国内リート市況は、期首より、海外を中心に中期的な金利上昇への警戒感が残っていることや、海外投資家および国内リートに投資する投資信託からの資金流出などを背景に、2017年7月にかけて下落基調で推移しました。その後は一時反発しましたが、北朝鮮に関わる地政学リスクが高まったことや米国の長期金利が上昇したことから、再び下落しました。しかし2017年11月中旬には、自己投資口取得やリート同士の合併の発表などを材料に上昇に転じました。2018年に入ると、事業環境が良好なことから国内外投資家からの資金が継続的に流入したことなどにより、好調な推移となりました。しかし2月に入ると、米国の長期金利が急上昇したことなどをを受けて国内外で株式市場が下落する中で、国内リート市場も下落しました。3月以降は、オフィス市況など事業環境の良好さが継続していることや日本の長期金利が低位安定推移となったことなどを背景に上昇し、期末を迎えました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■ダイワJ-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（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

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券を通じて行ないました。

■ダイワJ-REITマザーファンド

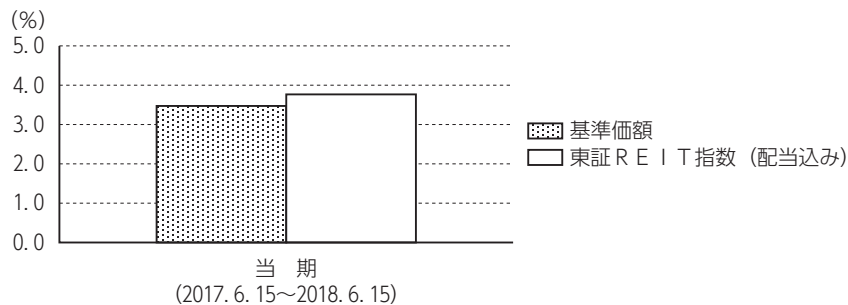
ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物含む。）については、期を通じて99~100%程度としました。

ベンチマークとの差異について

当期のベンチマーク（東証REIT指数（配当込み））の騰落率は3.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は3.5%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2017年6月16日 ~2018年6月15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)	431

- (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

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■ダイワJ-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。

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2017. 6. 16~2018. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	33円	0.335%	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9,740円です。
(投信会社)	(20)	(0.205)	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、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(2)	(0.022)	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
(先物)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.005	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	33	0.341	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
ダイワ J-REIT マザーファンド	459,928	1,089,343	30,885	75,239

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

種類	当期		
	ダイワJ-REITマザーファンド		
	買付額	売付額	期末保有額
投資信託証券	64	1,095	3,515

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

種類	当 期	
	ダイワJ-REITマザーファンド	買付額
投資信託証券		百万円 1,007

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
ダイワJ-REITマザーファンド	千口 502,936	千口 931,979	千円 2,350,731

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ダイワJ-REITマザーファンド	千円 2,350,731	% 97.8
コール・ローン等、その他	52,973	2.2
投資信託財産総額	2,403,704	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

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,403,704,656円
コール・ローン等	36,123,369
ダイワJ-REITマザーファンド (評価額)	2,350,731,287
未収入金	16,850,000
(B) 負債	48,329,687
未払解約金	44,666,343
未払信託報酬	3,605,144
その他未払費用	58,200
(C) 純資産総額 (A-B)	2,355,374,969
元本	2,297,924,064
次期繰越損益金	57,450,905
(D) 受益権総口数	2,297,924,064口
1万口当り基準価額 (C/D)	10,250円

*期首における元本額は1,235,784,993円、当期中における追加設定元本額は1,366,263,589円、同解約元本額は304,124,518円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,250円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3,718円
受取利息	65
その他収益金	482
支払利息	△ 4,265
(B) 有価証券売買損益	113,664,102
売買益	118,982,023
売買損	△ 5,317,921
(C) 信託報酬等	△ 6,175,811
(D) 当期損益金 (A+B+C)	107,484,573
(E) 前期繰越損益金	△ 8,417,460
(F) 追加信託差損益金	△ 41,616,208
(配当等相当額)	(△) 2,154
(売買損益相当額)	(△) 41,614,054
(G) 合計 (D+E+F)	57,450,905
次期繰越損益金 (G)	57,450,905
追加信託差損益金	△ 41,616,208
(配当等相当額)	(△) 2,154
(売買損益相当額)	(△) 41,614,054
分配準備積立金	99,070,831
繰越損益金	△ 3,718

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

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

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	99,070,831
(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)	99,070,831
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	99,070,831
(h) 受益権総口数	2,297,924,064口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ J-REITインデックス）が投資対象としている「ダイワJ-REITマザーファンド」の決算日（2018年3月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15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231ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワJ-REITマザーファンドの主要な売買銘柄
投資信託証券

（2017年6月16日から2018年6月15日まで）

買 付				売 付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
日本プロロジスリート	4.94	1,138,666	230,499	日本ビルファンド	8.543	4,864,659	569,432
GLP投資法人	8.832	1,020,731	115,571	ジャパンリアルエステイト	8.162	4,467,274	547,325
大和ハウスリート投資法人	3.89	981,165	252,227	日本リートファンド	17.876	3,658,213	204,643
ジャパンリアルエステイト	1.581	878,548	555,691	野村不動産マスターF	24.461	3,560,594	145,562
三菱地所物流REIT	2.725	749,955	275,213	ユナイテッド・アーバン投資法人	19.457	3,186,368	163,764
インヴィンシブル投資法人	14.788	673,468	45,541	オリックス不動産投資	16.256	2,618,945	161,106
インベスコ・オフィス・Jリート	38.64	561,776	14,538	日本プロロジスリート	10.494	2,491,061	237,379
星野リゾート・リート	0.935	518,183	554,206	大和ハウスリート投資法人	8.985	2,371,575	263,948
ジャパン・ホテル・リート投資法人	6.281	492,346	78,386	アドバンス・レジデンス	8.166	2,232,412	273,378
野村不動産マスターF	2.933	433,281	147,726	日本プライムリアルティ	5.571	2,119,543	380,460

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年6月15日現在におけるダイワJ-REITマザーファンド（84,131,299千口）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

ファンド名	2018年6月15日現在				ファンド名	2018年6月15日現在			
	口数	評価額	比率			口数	評価額	比率	
	千口	千円	%		千口	千円	%		
不動産投信									
日本アコモデーションファンド投資法人	8.491	4,169,081	2.0	日本プライムリアルティ	16.132	6,517,328	3.1		
MCUBS MidCity投資法人	28.509	2,366,247	1.1	プレミア投資法人	23.079	2,444,066	1.2		
森ヒルズリート	27.448	3,845,464	1.8	東急リアル・エステート	17.131	2,545,666	1.2		
産業ファンド	29.675	3,584,740	1.7	グローバル・ワン不動産投資法人	16.228	1,785,080	0.8		
アドバンス・レジデンス	23.657	6,564,817	3.1	ユナイテッド・アーバン投資法人	56.354	9,721,065	4.6		
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	12.998	2,106,975	1.0	森トラスト総合リート	18.261	2,921,760	1.4		
API投資法人	11.559	5,606,115	2.6	インヴィンシブル投資法人	70.077	3,559,911	1.7		
GLP投資法人	53.043	6,328,029	3.0	フロンティア不動産投資	8.692	3,920,092	1.8		
コンフォリア・レジデンシャル	9.685	2,511,320	1.2	平和不動産リート	15.912	1,715,313	0.8		
日本プロロジスリート	34.056	7,819,257	3.7	日本ロジスティクスファンド投資法人	17.022	3,835,056	1.8		
星野リゾート・リート	4.038	2,269,356	1.1	福岡リート投資法人	13.215	2,296,767	1.1		
Oneリート投資法人	2.793	702,998	0.3	ケネディクス・オフィス投資法人	7.884	5,392,656	2.5		
イオンリート投資	24.264	2,977,192	1.4	いちごオフィスリート投資法人	19.785	1,646,112	0.8		
ヒューリックリート投資法	17.353	2,929,186	1.4	大和証券オフィス投資法人	5.51	3,515,380	1.7		
日本リート投資法人	6.865	2,244,855	1.1	阪急リート投資法人	11.154	1,534,790	0.7		
インベスコ・オフィス・Jリート	150.554	2,198,088	1.0	スターツプロシード投資法人	4.026	654,627	0.3		
日本ヘルスケア投資法	1.239	211,373	0.1	大和ハウスリート投資法人	29.73	7,786,287	3.7		
積水ハウス・リート投資	64.0174	4,397,995	2.1	ジャパン・ホテル・リート投資法人	73.747	5,973,507	2.8		
トーセイ・リート投資法人	4.108	460,917	0.2	日本賃貸住宅投資法人	28.74	2,509,002	1.2		
ケネディクス商業リート	9.291	2,276,295	1.1	ジャパンエクセレント投資法人	22.881	3,304,016	1.6		
ヘルスケア&メディカル投資	3.148	345,020	0.2						
サムティ・レジデンシャル	4.437	427,283	0.2	合計	口数、金額	1,294,6384	209,017,190		
野村不動産マスターF	75.614	11,886,520	5.6		銘柄数<比率>	59銘柄	<98.5%>		
いちごホテルリート投資	3.998	530,934	0.3						
ラサールロジポート投資	19.276	2,141,563	1.0						
スターアジア不動産投	5.993	634,658	0.3						
マリモ地方創生リート	2.046	239,382	0.1						
三井不ロジパーク	4.833	1,635,970	0.8						
大江戸温泉リート	4.289	374,429	0.2						
さくら総合リート	6.143	565,770	0.3						
投資法人みらい	3.73	697,510	0.3						
森トラスト・ホテルリート投	5.534	816,818	0.4						
三菱地所物流REIT	2.368	639,360	0.3						
CRE ロジスティクスファンド	2.558	291,356	0.1						
ザイマックス・リート	2.356	268,584	0.1						
日本ビルファンド	24.743	15,315,917	7.2						
ジャパンリアルエステイト	25.424	14,542,528	6.9						
日本リートファンド	48.248	9,683,373	4.6						
オリックス不動産投資	50.697	8,831,417	4.2						

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

(2) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別	2018年6月15日現在	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
国内 東証REIT	3,098	—

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

運用報告書 第28期（決算日 2018年3月15日）

（計算期間 2017年9月16日～2018年3月15日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴ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。

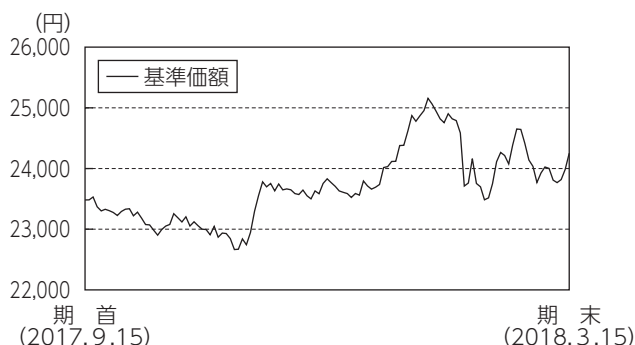
運用方針	東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」（配当込み、以下同じ。）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
運用方法	①東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ②投資成果を「東証REIT指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証REIT指数」の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。 ③運用の効率化を図るため、不動産投資指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投資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)		不動産投資信託証券先物比率	
	円	%	(ベンチマーク)	%	%	%
(期首)2017年9月15日	23,482	-	3,165.38	-	98.5	1.5
9月末	23,293	△0.8	3,139.87	△0.8	98.2	1.5
10月末	22,995	△2.1	3,099.44	△2.1	98.3	1.6
11月末	23,664	0.8	3,189.89	0.8	98.2	1.6
12月末	23,660	0.8	3,189.59	0.8	98.4	1.4
2018年1月末	24,902	6.0	3,357.09	6.1	98.3	1.4
2月末	24,415	4.0	3,291.44	4.0	98.0	1.5
(期末)2018年3月15日	24,252	3.3	3,269.20	3.3	98.2	1.6

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) 不動産投資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：23,482円 期末：24,252円 騰落率：3.3%

【基準価額の主な変動要因】

東証REIT指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざした運用を行なった結果、国内リートの投資口価格の割安感が高まったことなどを背景に、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は、期首より、北朝鮮をめぐる地政学リスクの高まりや、好調な経済指標などを背景に米国の長期金利が上昇したことから、下落して始まりました。不動産市況が活況な一方でリート市況は低迷しましたが、徐々に割安感が高まり、自己投資口取得やM&A（企業の合併・買収）などを材料に、2017年11月中旬から上昇に転じました。2018年に入ると、事業環境が良好なことから国内外投資家からの資金が継続的に流入したことや、日本株に比べ出遅れ感があったことなどから好調な推移となりました。しかし2月に入ると、1月の米国雇用統計をきっかけに国内外で株式市場が下落する中で、国内リート市場も下落しました。その後は反発する場面も見られたものの、期末にかけて不安定な推移となりました。

◆前期における「今後の運用方針」

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマーク（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

ベンチマーク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（不動産投資指数先物を含む。）については、期を通じて99～100%程度としました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は3.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は3.3%となりました。ポートフォリオの騰落率と東証REIT指数の騰落率の違い、先物取引の影響、売買等のコストが控除されたことが差異の要因となりました。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (先物)	0円 (0)
有価証券取引税	—
その他費用	—
合計	0

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

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2017年9月16日から2018年3月15日まで)

	買		付		売		付	
	口数	金額	口数	金額	口数	金額	口数	金額
国内	205,738	千円 6,418,448	201,682	千円 ()	36,915	千円 3,680,000	—	千円 ()

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2017年9月16日から2018年3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	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内 不動産投資指数先物取引	百万円 6,568	百万円 6,916	百万円 —	百万円 —	百万円 —	百万円 —	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
投資信託証券

(2017年9月16日から2018年3月15日まで)

当 期				当 期			
買 付		平均単価		売 付		平均単価	
銘柄	口数	金額	円	銘柄	口数	金額	円
GLP投資法人	8,203	945,014	115,203	日本ビルファンド	4,898	2,733,487	558,082
三菱地所物流REIT	2,716	747,568	275,246	ジャパンリアルエステイト	4,783	2,573,695	538,092
インヴィンシブル投資法人	13,975	633,697	45,345	日本リテールファンド	9,733	1,980,922	203,526
日本プロロジスリート	1,917	435,558	227,208	野村不動産マスターF	13,554	1,921,938	141,798
星野リゾート・リート	0,727	405,629	557,949	ユナイテッド・アーバン投資法人	11,157	1,830,747	164,089
野村不動産マスターF	1,946	282,508	145,174	日本プロロジスリート	6,066	1,449,207	238,906
三井不動産パーク	0,708	266,966	377,070	オリックス不動産投資	8,931	1,417,867	158,775
産業ファンド	1,796	230,120	128,129	大和ハウスリート投資法人	5,052	1,328,812	263,027
A P I 投資法人	0,476	224,735	472,132	アドバンス・レジデンス	4,683	1,269,768	271,144
イオンリート投資	1,764	201,839	114,421	日本プライムリアルティ	3,194	1,179,350	369,239

(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債ファンドの明細

ファンズ名	当 期			末		
	口数	評価額	比率	口数	評価額	比率
不動産投信						
日本アコモデーションファンド投資法人	8,842	4,204,371	2.0			
MCUBS MidCity投資法人	29,689	2,274,177	1.1			
森ヒルズリート	28,585	3,864,692	1.8			
産業ファンド	30,914	3,697,314	1.7			
アドバンス・レジデンス	24,636	6,863,589	3.2			
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	13,536	2,057,472	1.0			
A P I 投資法人	12,038	5,651,841	2.7			
GLP投資法人	55,238	6,457,322	3.1			
コンフォリア・レジデンシャル	10,086	2,480,147	1.2			
日本プロロジスリート	35,466	8,249,391	3.9			
星野リゾート・リート	4,04	2,274,520	1.1			
Oneリート投資法人	2,909	712,995	0.3			
イオンリート投資	25,268	2,857,810	1.4			
ヒュリックリート投資法人	18,071	2,913,045	1.4			
日本リート投資法人	7,149	2,298,403	1.1			
インベスコ・オフィス・Jリート	117,948	1,776,296	0.8			
日本ヘルスケア投資法人	1,29	223,815	0.1			
積水ハウス・リート投資	16,691	2,410,180	1.1			
トーセイ・リート投資法人	4,278	477,424	0.2			
ケネディクス商業リート	9,676	2,330,948	1.1			
ヘルスケア&メディカル投資	3,279	343,967	0.2			
サムティ・レジデンシャル	4,621	425,594	0.2			
野村不動産マスターF	78,747	11,410,440	5.4			
いちごホテルリート投資	4,163	519,958	0.2			
ラサールレジポート投資	20,074	2,280,406	1.1			
スターアジア不動産投	6,241	642,823	0.3			
マリモ地方創生リート	2,13	236,217	0.1			
三井不動産パーク	5,033	1,769,099	0.8			
大江戸温泉リート	4,467	383,715	0.2			
さくら総合リート	6,397	600,038	0.3			
投資法人みらい	3,386	637,245	0.3			
森トラスト・ホテルリート投	5,763	824,109	0.4			
三菱地所物流REIT	2,466	644,859	0.3			
日本ビルファンド	25,768	14,919,672	7.1			
ジャパンリアルエステイト	25,151	13,833,050	6.5			
日本リテールファンド	51,189	10,411,842	4.9			
オリックス不動産投資	52,797	8,753,742	4.1			
日本プライムリアルティ	16,799	6,266,027	3.0			
プレミア投資法人	24,034	2,667,774	1.3			
東急リアル・エステート	17,84	2,556,472	1.2			
グローバル・ワン不動産投資法人	4,272	1,742,976	0.8			
ユナイテッド・アーバン投資法人	58,687	9,865,284	4.7			
森トラスト総合リート	19,017	3,033,211	1.4			
インヴィンシブル投資法人	72,978	3,586,868	1.7			
フロンティア不動産投資	9,051	3,964,338	1.9			
平和不動産リート	16,57	1,660,314	0.8			
日本ロジスティクスファンド投資法人	17,726	3,873,131	1.8			
福岡リート投資法人	13,762	2,284,492	1.1			
ケネディクス・オフィス投資法人	7,778	5,149,036	2.4			
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	20,174	2,388,601	1.1			
いちごオフィスリート投資法人	20,604	1,631,836	0.8			
大和証券オフィス投資法人	5,738	3,557,560	1.7			
阪急リート投資法人	11,615	1,542,472	0.7			
スタートアップリート投資法人	4,193	696,876	0.3			
大和ハウスリート投資法人	27,517	6,851,733	3.2			
ジャパン・ホテル・リート投資法人	76,8	5,928,960	2.8			
日本賃貸住宅投資法人	29,929	2,484,107	1.2			
ジャパンエクセレント投資法人	23,828	3,393,107	1.6			
合 計	1,256,934	207,837,718	<98.2%>			

※産業ファンド、A P I 投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル、日本プロロジスリート、イオンリート投資、ヒュリックリート投資法人、日本ヘルスケア投資法人、積水ハウス・リート投資、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート、サムティ・レジデンシャル、マリモ地方創生リート、三井不動産パーク、三菱地所物流REIT、日本ビルファンド、日本リテールファンド、オリックス不動産投資、日本プライムリアルティ、グローバル・ワン不動産投資法人、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、ケネディクス・オフィス投資法人、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、阪急リート投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人につきましては、各ファンドで開示されている直近の有価証券報告書または有価証券届出書において、当社の利害関係人等（投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される法人等）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おります。
(注1) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別	当 期		末	
	買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額
国内 東証REIT	百万円 3,351		百万円	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年3月15日現在

項 目	当 期		末	
	評価額	比率	千円	%
投資信託証券	207,837,718	97.3		
コール・ローン等、その他	5,691,751	2.7		
投資信託財産総額	213,529,470	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

2018年3月15日現在

項 目	当 期	末
(A) 資産		213,888,445,160円
コール・ローン等		1,233,781,303
投資信託証券(評価額)		207,837,718,980
未収入金		1,684,472,652
未収配当金		2,773,497,225
差入委託証拠金		358,975,000
(B) 負債		2,303,430,634
未払金		104,064,660
未払解約金		1,813,590,100
差入委託証拠金代用有価証券		385,775,000
その他未払費用		874
(C) 純資産総額(A-B)		211,585,014,526
元本		87,243,538,784
次期繰越損益金		124,341,475,742
(D) 受益権総口数		87,243,538,784口
1万口当り基準価額(C/D)		24,252円

*期首における元本額は102,250,435,372円、当期中における追加設定元本額は1,897,822,046円、同解約元本額は16,904,718,634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9,204,141,206円、ダイワJ-REITオープン(毎月分配型)70,871,803,139円、ダイワJ-REITオープン(年1回決算型)411,842,431円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 30,514円、iFree J-REITインデックス128,856,294円、iFree 8資産バランス345,334,609円、DC・ダイワJ-REITオープン3,494,921,588円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 3,156,621円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 5,659,387円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 1,303,201円、ダイワ・ノロードJ-REITファンド55,432,814円、ダイワファンドラップJ-REITインデックス899,788,452円、ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)1,416,373円、ダイワファンドラップオンラインJ-REITインデックス300,053,575円、ダイワ・インデックスセレクトJ-REIT1,519,798,580円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は24,252円です。

■損益の状況

当期 自2017年9月16日 至2018年3月15日

項 目	当 期	期
(A) 配当等収益		4,734,234,464円
受取配当金		4,729,720,862
その他収益金		5,011,082
支払利息	△	497,480
(B) 有価証券売買損益		1,947,567,160
売買益		5,709,420,396
売買損	△	3,761,853,236
(C) 先物取引等損益		109,167,456
取引益		112,862,856
取引損	△	3,695,400
(D) その他費用		874
(E) 当期損益金(A+B+C+D)		6,790,968,206
(F) 前期繰越損益金		137,856,800,148
(G) 解約差損益金	△	22,900,912,266
(H) 追加信託差損益金		2,594,619,654
(I) 合計(E+F+G+H)		124,341,475,742
次期繰越損益金(I)		124,341,475,742

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

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

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス （為替ヘッジあり）

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2018年6月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）」は、このたび、第2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/>

<2736>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	不動産投資 指数 先物比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率					
1期末(2017年6月15日)	円 9,844	円 0	% △ 1.6	9,995	% △ 0.1	—	% 98.2	% —	百万円 5,285
2期末(2018年6月15日)	円 9,722	円 0	% △ 1.2	10,123	% 1.3	0.8	% 99.1	% 1.0	8,688

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

(注2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

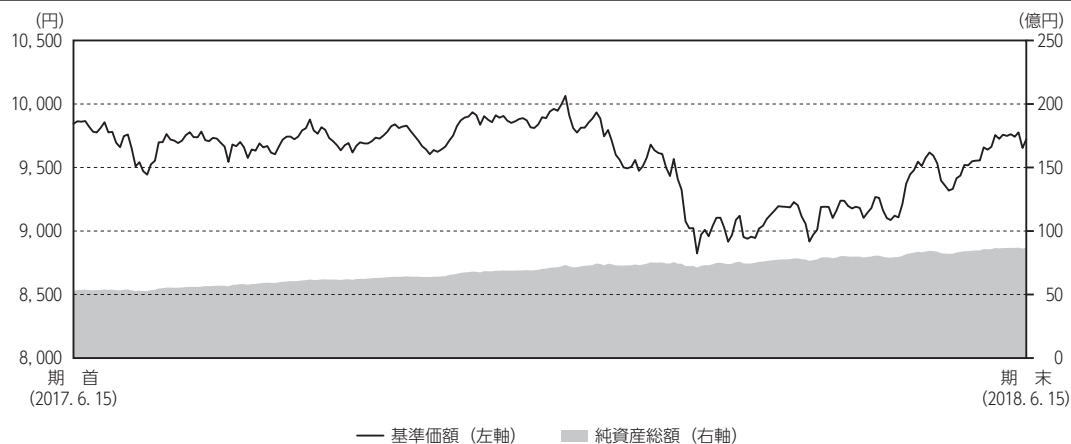
(注3) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 不動産投資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：9,844円

期末：9,722円

騰落率：△1.2%

■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートに投資し、為替ヘッジした結果、米国リート市況の下落や為替ヘッジコストの影響が大きく、当ファンドの基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	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	(参考指数)	騰 落 率			
(期首)2017年6月15日	9,844	—	9,995	—	—	98.2	—
6月末	9,696	△ 1.5	9,857	△ 1.4	—	100.6	—
7月末	9,739	△ 1.1	9,925	△ 0.7	0.3	98.1	—
8月末	9,664	△ 1.8	9,866	△ 1.3	0.2	98.8	—
9月末	9,670	△ 1.8	9,888	△ 1.1	0.6	100.6	—
10月末	9,623	△ 2.2	9,861	△ 1.3	0.4	98.8	0.6
11月末	9,863	0.2	10,130	1.4	0.3	97.6	0.5
12月末	9,934	0.9	10,236	2.4	1.0	97.9	1.2
2018年1月末	9,433	△ 4.2	9,728	△ 2.7	0.9	95.1	1.1
2月末	8,953	△ 9.1	9,238	△ 7.6	0.6	95.8	1.1
3月末	9,191	△ 6.6	9,506	△ 4.9	0.8	97.5	1.0
4月末	9,213	△ 6.4	9,551	△ 4.4	0.8	100.3	1.0
5月末	9,658	△ 1.9	10,042	0.5	0.7	96.8	1.0
(期末)2018年6月15日	9,722	△ 1.2	10,123	1.3	0.8	99.1	1.0

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■海外リート市況

米国リート市況は、期首より、米国景気の底堅さやトランプ政権に対する政策期待などの好材料がある一方、利上げ懸念や北朝鮮をはじめとした地政学リスクもあって、方向感のない動きとなりました。しかし2018年に入ると、好調な経済指標の発表により早期利上げ観測が高まったことから長期金利が上昇し、利回り資産としてのリートに売り圧力が強まりました。期末にかけては、主要リーートの好調な決算発表を受けやや値を戻しました。カナダリート市況は、期を通じて緩やかな上昇となりました。

欧州リート市況は、期首より、ドイツなどで長期金利が上昇に転じたことや、フランス大手リーートの増資発表が悪材料となり、上値が重い展開となりました。その後は、長期金利の影響を受ける一進一退の値動きとなりました。2017年11月から12月にかけては、好調な不動産ファンダメンタルズや大手商業施設リートに対する買収観測などが好材料となり、フランスやドイツを中心として総じて堅調に推移しました。2018年に入ると、堅調な景気を受けた長期金利の上昇や米国株式の急落から売られる展開となりましたが、期末にかけては急落の反動で緩やかな上昇に転じました。

アジア・オセアニアリート市況は、香港およびシンガポールは、期首から、自国金利が低下に転じたことや中国政府への政策期待などにより、上昇しました。2017年8月以降は、アジアでは小動きな展開となりましたが、11月からは、一部リーートの好決算や世界的な景気見通しの改善などを反映し、上昇しました。2018年に入ると、他地域と同様に下落基調となりましたが、期末にかけて香港は再び上昇しました。オーストラリアは、期首から商業施設セクターを中心に売られましたが、その後はアジア地域と似た値動きとなりました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。また、保有外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いません。

■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 (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いません。リーートの組入比率は、期を通じて原則として98%以上で運用を行いません。

ポートフォリオについて

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■当ファンド

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

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

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

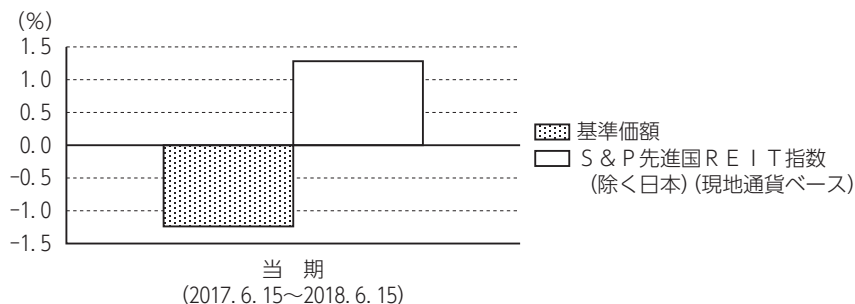
また、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ETF）および不動産投信指数先物を組み入れました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。参考指数とのかい離の主要因は、為替ヘッジを行なったことによるものです。



分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2017年6月16日 ～2018年6月15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)	402

(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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。また、保有外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いません。

■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、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いません。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ETF）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2017. 6. 16~2018. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	41円	0.426%	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9,564円です。
(投信会社)	(28)	(0.297)	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)	(10)	(0.108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	2	0.019	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 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
(先物)	(0)	(0.002)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(2)	(0.017)	
有価証券取引税	3	0.027	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
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(3)	(0.027)	
その他費用	12	0.125	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)	(11)	(0.112)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(1)	(0.008)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	57	0.598	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	1,797,367	3,864,600	218,166	475,990

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	2,420,500	3,999,701	8,805,742

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	8,805,742	99.7
コール・ローン等、その他	23,834	0.3
投資信託財産総額	8,829,577	100.0

- (注1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.68円、1カナダ・ドル=84.33円、1オーストラリア・ドル=82.53円、1香港ドル=14.10円、1シンガポール・ドル=82.20円、1ニュージーランド・ドル=76.93円、1イギリス・ポンド=146.66円、1イスラエル・シケル=30.62円、1ユーロ=127.90円です。
 (注3) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(16,700,675千円)の投資信託財産総額(16,888,374千円)に対する比率は、98.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	17,421,747,562円
コール・ローン等	23,503,744
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)	8,805,742,899
未収入金	8,592,500,919
(B)負債	8,733,320,880
未払金	8,711,882,993
未払解約金	4,682,249
未払信託報酬	16,545,848
その他未払費用	209,790
(C)純資産総額(A-B)	8,688,426,682
元本	8,936,929,166
次期繰越損益金	△ 248,502,484
(D)受益権総口数	8,936,929,166口
1万口当り基準価額(C/D)	9,722円

*期首における元本額は5,369,088,014円、当期中における追加設定元本額は4,660,565,456円、同解約元本額は1,092,724,304円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,722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248,502,484円です。

■損益の状況

当期自2017年6月16日至2018年6月15日

項 目	当 期
(A)配当等収益	△ 11,009円
受取利息	746
支払利息	△ 11,755
(B)有価証券売買損益	41,575,960
売買益	839,997,515
売買損	△ 798,421,555
(C)信託報酬等	△ 29,944,743
(D)当期損益金(A+B+C)	11,620,208
(E)前期繰越損益金	180,460,815
(F)追加信託差損益金	△ 440,583,507
(配当等相当額)	(167,889,634)
(売買損益相当額)	(△ 608,473,141)
(G)合計(D+E+F)	△ 248,502,484
次期繰越損益金(G)	△ 248,502,484
追加信託差損益金	△ 440,583,507
(配当等相当額)	(167,889,634)
(売買損益相当額)	(△ 608,473,141)
分配準備積立金	192,092,032
繰越損益金	△ 11,009

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

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

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a)経費控除後の配当等収益	0円
(b)経費控除後の有価証券売買等損益	11,630,148
(c)収益調整金	167,889,634
(d)分配準備積立金	180,461,884
(e)当期分配対象額(a+b+c+d)	359,981,666
(f)分配金	0
(g)翌期繰越分配対象額(e-f)	359,981,666
(h)受益権総口数	8,936,929,166口

《お知らせ》

■マザーファンドにおける先物取引の利用について

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

<補足情報>

当ファンド（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））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（2017年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15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240～245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

(1) 投資信託受益証券

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 43.6	千円 382,712	円 8,777	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 28	千円 237,567	円 8,484

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	千口 16.3	千円 285,026	円 17,486	WESTFIELD CORP (オーストラリア)	千口 255.6	千円 185,958	円 727
UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)	10.04	255,656	25,463	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	1.2	21,898	18,248
PROLOGIS INC (アメリカ)	28.7	198,347	6,911	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA (スペイン)	13.34	20,952	1,570
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	8.1	180,563	22,291	MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I (アメリカ)	15	20,301	1,353
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	7.4	142,291	19,228	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST (カナダ)	4.7	19,954	4,245
WELLTOWER INC (アメリカ)	19.9	139,706	7,020	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA (スペイン)	7.03	14,549	2,069
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	19.8	138,450	6,992	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE (カナダ)	18.9	12,965	686
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	10.5	127,895	12,180	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	0.4	9,522	23,806
VENTAS INC (アメリカ)	18.9	122,919	6,503	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	0.4	8,430	21,075
LINK REIT (香港)	115.5	108,667	940	PROLOGIS INC (アメリカ)	1.2	8,245	6,871

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年6月15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（7,648,262千口）の内容です。

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた外貨建ファンドの明細

(i) 外国投資信託受益証券

ファンド名	2018年6月15日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) VANGUARD REAL ESTATE ETF	千口 15.6	千アメリカ・ドル 1,243	千円 137,679	% 0.8

(注1) 邦貨換算金額は、2018年6月15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。

(ii) 外国投資信託証券

ファンド名	2018年6月15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	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
(シンガポール) MANULIFE US REAL ESTATE INV	151.527	133	14,758	0.1
(アメリカ) PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	9.2	367	40,699	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	10.1	75	8,350	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	13.482	299	33,096	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	13.8	337	37,359	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	18.4	3,094	342,500	2.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	41.547	6,815	754,371	4.5
BOSTON PROPERTIES INC	20.5	2,457	272,000	1.6
APARTMENT INVNT & MGMT CO -A	20.755	859	95,079	0.6
GGP INC	83.877	1,738	192,447	1.1
VORNADO REALTY TRUST	23.064	1,659	183,642	1.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	5.6	110	12,247	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	6.1	180	19,957	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	2.4	65	7,206	0.0
QTS REALTY TRUST INC-CL A	6.4	257	28,497	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	49.2	3,136	347,147	2.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	27.9	522	57,868	0.3
EPR PROPERTIES	8.6	547	60,566	0.4

ファンド名	2018年6月15日現在			
	□ 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	%
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1.7	15	1,708	0.0
CITY OFFICE REIT INC	3.8	46	5,156	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	8.333	161	17,883	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8.029	184	20,430	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	5.4	110	12,180	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	8	254	28,201	0.2
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3.1	133	14,763	0.1
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6.6	552	61,127	0.4
FOREST CITY REALTY TRUST- A	35.2	711	78,736	0.5
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	14.1	264	29,307	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2.3	63	7,061	0.0
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4.113	43	4,861	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	97.5	2,079	230,178	1.4
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	33.208	698	77,331	0.5
GRAMERCY PROPERTY TRUST	21.395	590	65,404	0.4
CORESITE REALTY CORP	4.5	485	53,685	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	20.4	719	79,612	0.5
RLJ LODGING TRUST	23.371	523	57,967	0.3
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	26	2,885	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	23.5	357	39,586	0.2
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	5.2	76	8,425	0.1
CYRUSONE INC	12.8	751	83,203	0.5
KIMCO REALTY CORP	56.5	933	103,369	0.6
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1.8	16	1,797	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	27.05	677	74,967	0.4
WHITESTONE REIT	4.4	53	5,897	0.0
TIER REIT INC	6.4	146	16,249	0.1
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	0.237	0	100	0.0
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3	30	3,423	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	26.5	933	103,359	0.6
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17.7	341	37,848	0.2
QUALITY CARE PROPERTIES	11.8	260	28,784	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC	26.5	814	90,161	0.5
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	68.711	418	46,314	0.3
INVITATION HOMES INC	37.897	849	94,039	0.6
JBG SMITH PROPERTIES	12.132	457	50,676	0.3
ALEXANDER & BALDWIN INC	8.433	177	19,609	0.1
CLIPPER REALTY INC	1.4	13	1,538	0.0
GLADSTONE LAND CORP	0.9	11	1,270	0.0
INFRAREIT INC	4.7	97	10,809	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	6	130	14,390	0.1
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2.5	54	6,084	0.0
SPIRIT MTA REIT	5.87	59	6,561	0.0
WASHINGTON PRIME GROUP INC	24.16	188	20,884	0.1
CORECIVIC INC	15.524	328	36,408	0.2
STORE CAPITAL CORP	21.8	585	64,856	0.4
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	12.8	182	20,145	0.1
LIFE STORAGE INC	6.2	578	64,003	0.4
SELECT INCOME REIT	8.2	176	19,494	0.1
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5.4	201	22,305	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	9.982	100	11,081	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	4.2	61	6,851	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	26.5	399	44,259	0.3
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	16.5	279	30,881	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	10.2	321	35,561	0.2
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	15.2	337	37,347	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	12.5	330	36,607	0.2
VENTAS INC	47.579	2,588	286,525	1.7
CARETRUST REIT INC	9.803	163	18,097	0.1
GEO GROUP INC/THE	16.3	406	44,993	0.3
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	40.2	697	77,195	0.5
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	13.1	188	20,878	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	23.387	500	55,341	0.3
UMH PROPERTIES INC	4.2	61	6,861	0.0
IRON MOUNTAIN INC	37.4	1,271	140,699	0.8
TERRENO REALTY CORP	7.1	267	29,617	0.2
VEREIT INC	128.408	929	102,896	0.6
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	58.7	477	52,819	0.3
SUN COMMUNITIES INC	10.6	1,023	113,238	0.7
ACADIA REALTY TRUST	11.111	302	33,498	0.2
ALEXANDER'S INC	0.5	191	21,197	0.1
PROLOGIS INC	71.246	4,589	507,984	3.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13.5	1,723	190,747	1.1
BRANDYWINE REALTY TRUST	23.1	372	41,188	0.2
SAUL CENTERS INC	1.3	65	7,220	0.0

ファンド名	2018年6月15日現在			
	□ 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	%
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22.945	124	13,738	0.1
MACK-CALI REALTY CORP	11.6	228	25,279	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	12.3	1,108	122,740	0.7
COUSINS PROPERTIES INC	55.807	541	59,914	0.4
DDR CORP	19.578	337	37,378	0.2
DUKE REALTY CORP	47.1	1,344	148,831	0.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	4.6	434	48,066	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8.867	2,082	230,462	1.4
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	16	532	58,899	0.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9.7	1,174	130,001	0.8
GETTY REALTY CORP	4.203	111	12,336	0.1
WELLTOWER INC	49.2	2,835	313,876	1.9
HCP INC	62.7	1,496	165,649	1.0
HIGHWOODS PROPERTIES INC	13.7	662	73,298	0.4
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	22	625	69,250	0.4
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	16.7	452	50,071	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	16.575	512	56,760	0.3
KILROY REALTY CORP	13	987	109,337	0.6
LASALLE HOTEL PROPERTIES	14.6	518	57,397	0.3
LIBERTY PROPERTY TRUST	19.6	867	96,057	0.6
LTC PROPERTIES INC	5.1	216	23,944	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	27.7	238	26,427	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15.128	1,465	162,195	1.0
MACERICH CO/THE	14.5	813	90,064	0.5
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11.8	1,082	119,827	0.7
NATL HEALTH INVESTORS INC	5.3	394	43,701	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	20.2	851	94,280	0.6
REALTY INCOME CORP	37.717	1,998	221,207	1.3
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	13.1	358	39,712	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8.6	96	10,708	0.1
PUBLIC STORAGE	20	4,289	474,728	2.8
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2.7	334	36,980	0.2
REGENCY CENTERS CORP	19.52	1,171	129,650	0.8
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	10.1	128	14,275	0.1
ISTAR INC	8.4	91	10,087	0.1
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	11.8	263	29,137	0.2
SL GREEN REALTY CORP	12	1,174	129,947	0.8
SENIOR HOUSING PROP TRUST	31.6	552	61,136	0.4
TAUBMAN CENTERS INC	7.8	435	48,189	0.3
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3.5	76	8,464	0.1
UDR INC	35.6	1,320	146,181	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.6	101	11,209	0.1
WP CAREY INC	14.1	944	104,512	0.6
WASHINGTON REIT	10.4	302	33,519	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	15.4	462	51,151	0.3
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11.3	80	8,879	0.1
AGREE REALTY CORP	3.9	209	23,227	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	26.05	814	90,158	0.5
CUBESMART	23.9	749	82,955	0.5
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	30.126	498	55,216	0.3
DIGITAL REALTY TRUST INC	27.478	2,929	324,290	1.9
CEDAR REALTY TRUST INC	6.9	30	3,390	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	16.7	1,628	180,270	1.1
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4.475	93	10,376	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	13.3	75	8,317	0.0
KITE REALTY GROUP TRUST	10.55	172	19,126	0.1
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	9.7	149	16,597	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1.5	38	4,276	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	17.9	765	84,714	0.5
EDUCATION REALTY TRUST INC	10.1	407	45,061	0.3
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3.6	67	7,478	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	25.642	314	34,822	0.2
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	6.849	97	10,802	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	48.1	664	73,573	0.4
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13.7	106	11,827	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	20.9	809	89,590	0.5
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	12.5	820	90,826	0.5
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	29.5	383	42,413	0.3
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,074.141 161銘柄	105,938 11,725,231	<69.6%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9	119	10,063	0.1
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	12.4	177	15,005	0.1
SLATE RETAIL REIT - U	1.7	21	1,849	0.0

ファンド名	2018年6月15日現在			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千□	千カナダ・ドル	千円	%
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5.3	79	6,699	0.0
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	2.7	36	3,103	0.0
SLATE OFFICE REIT	2.8	21	1,780	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	5.6	63	5,331	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	4.5	38	3,259	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3	159	13,438	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	5.2	54	4,586	0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5.9	64	5,433	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	17.6	212	17,884	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1.7	26	2,219	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5.2	67	5,713	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	8.5	256	21,669	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9.3	395	33,354	0.2
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	10.79	134	11,364	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	18.766	377	31,840	0.2
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	2.3	30	2,564	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	21.4	511	43,095	0.3
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	129	10,897	0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2.8	129	10,960	0.1
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	3.1	80	6,828	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	4.9	63	5,338	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	6	247	20,831	0.1
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	175,856 25銘柄	3,499 295,116	<1.8%>
(オーストラリア)		千□	千オーストラリア・ドル	千円 %
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	29.9	81	6,687	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	207.42	228	18,830	0.1
RURAL FUNDS GROUP	31.95	67	5,590	0.0
VIVA ENERGY REIT	56.9	120	9,908	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	22.52	97	8,047	0.0
PROPERTYLINK GROUP	49.06	51	4,251	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	98.45	243	20,068	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	31.83	112	9,325	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	70.71	111	9,162	0.1
INDUSTRIA REIT	11.76	29	2,474	0.0
GDI PROPERTY GROUP	69.12	88	7,301	0.0
SCENTRE GROUP	722.52	3,041	251,040	1.5
ARENA REIT	35.38	79	6,569	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	15.31	49	4,068	0.0
BWP TRUST	63.71	207	17,141	0.1
DEXUS	136.95	1,314	108,503	0.6
GPT GROUP	244.92	1,227	101,268	0.6
INVESTA OFFICE FUND	67.5	347	28,689	0.2
CHARTER HALL RETAIL REIT	43.44	183	15,164	0.1
MIRVAC GROUP	505.6	1,127	93,051	0.6
STOCKLAND	330.36	1,370	113,148	0.7
ABACUS PROPERTY GROUP	40.47	154	12,725	0.1
GOODMAN GROUP	217.51	2,064	170,355	1.0
VICINITY CENTRES	438.51	1,157	95,542	0.6
CHARTER HALL GROUP	62.34	397	32,824	0.2
INGENIA COMMUNITIES GROUP	22.53	60	5,001	0.0
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,626.67 26銘柄	14,016 1,156,744	<6.9%>
(香港)		千□	千香港ドル	千円 %
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	146	798	11,260	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	132	728	10,273	0.1
FORTUNE REIT	188	1,769	24,944	0.1
PROSPERITY REIT	158	513	7,240	0.0
LINK REIT	296	21,134	297,995	1.8
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	106	355	5,006	0.0
CHAMPION REIT	277	1,512	21,325	0.1
香港ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,303 7銘柄	26,811 378,045	<2.2%>
(シンガポール)		千□	千シンガポール・ドル	千円 %
KEPPEL DC REIT	124.928	171	14,068	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	66.8	92	7,577	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	283.5	328	27,032	0.2
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	73.9	102	8,443	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	201.45	213	17,552	0.1
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	368.075	603	49,619	0.3
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	325.9	853	70,187	0.4
CAPITALAND MALL TRUST	363	736	60,572	0.4
SUNTEC REIT	301	511	42,061	0.2

ファンド名	2018年6月15日現在			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	271.4	333	27,440	0.2
KEPPEL REIT	235	263	21,635	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	78.46	108	8,900	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	166.5	181	14,918	0.1
ESR-REIT	175.437	84	6,922	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS	97.6	157	12,916	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	72	159	13,079	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	176.9	117	9,669	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	74	113	9,367	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	49.4	129	10,679	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	208.8	65	5,406	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	158.18	306	25,224	0.1
CACHE LOGISTICS TRUST	145.2	111	9,190	0.1
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	250.5	393	32,328	0.2
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	94.9	63	5,226	0.0
SPH REIT	70.5	70	5,795	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	64.9	42	3,467	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	78.1	33	2,792	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	84.8	65	5,402	0.0
OUE HOSPITALITY TRUST	140.673	110	9,077	0.1
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,801.803 29銘柄	6,527 536,554	<3.2%>
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
STRIDE PROPERTY GROUP	40.3	73	5,642	0.0
INVESTORE PROPERTY LTD	23.13	34	2,686	0.0
ARGOSY PROPERTY LTD	109	116	8,972	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	188.73	257	19,818	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	44.56	90	6,958	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	137.75	194	14,994	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	131.17	171	13,219	0.1
ニュージーランド・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	674.64 7銘柄	939 72,293	<0.4%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	313.84	177	26,097	0.2
CAPITAL & REGIONAL PLC	59.27	32	4,737	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	75.35	64	9,503	0.1
REGIONAL REIT LTD	35.96	34	5,010	0.0
NEWRIVER REIT PLC	38.2	110	16,134	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	22.49	23	3,397	0.0
LXI REIT PLC	21.16	23	3,444	0.0
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	7.57	6	1,016	0.0
RDI REIT PLC	173.26	61	8,995	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	101.931	972	142,570	0.8
HANSTEEN HOLDINGS PLC	50.32	54	7,955	0.0
SEGRO PLC	134.14	898	131,808	0.8
HAMMERSON PLC	107.61	576	84,497	0.5
UNITE GROUP PLC	35.49	307	45,127	0.3
BRITISH LAND CO PLC	134.84	933	136,847	0.8
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	37.001	260	38,143	0.2
INTU PROPERTIES PLC	117.04	225	33,111	0.2
DERWENT LONDON PLC	14.95	458	67,180	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	95.87	109	16,056	0.1
WORKSPACE GROUP PLC	15.5	174	25,619	0.2
SAFESTORE HOLDINGS PLC	28.24	162	23,897	0.1
SHAFTESBURY PLC	33.35	310	45,585	0.3
BIG YELLOW GROUP PLC	19.3	189	27,852	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	89.22	167	24,612	0.1
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	58.83	37	5,427	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	193.33	298	43,834	0.3
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,014.062 26銘柄	6,671 978,466	<5.8%>
(イスラエル)	千口	千イスラエル・シケル	千円	%
REIT 1 LTD	9.34	136	4,186	0.0
イスラエル・シケル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	9.34 1銘柄	136 4,186	<0.0%>
ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	40.86	54	7,002	0.0
GREEN REIT PLC	89.97	137	17,605	0.1
HIBERNIA REIT PLC	86.69	132	16,986	0.1
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	217.52 3銘柄	325 41,595	<0.2%>

ファンド名	2018年6月15日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ (オランダ)				
WERELDHAVE NV	5.2	172	22,060	0.1
EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	6.41	231	29,546	0.2
NSI NV	2.391	86	11,116	0.1
VASTNED RETAIL NV	2.05	83	10,697	0.1
国小計	16.051	574	73,421	<0.4%>
	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	4銘柄		
ユーロ (ベルギー)				
AEDIFICA	2.408	190	24,392	0.1
COFINIMMO	2.65	285	36,537	0.2
BEFIMMO	2.97	155	19,904	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	1.74	37	4,751	0.0
RETAIL ESTATES	0.98	75	9,714	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA	2.16	229	29,394	0.2
国小計	12.908	974	124,694	<0.7%>
	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	6銘柄		
ユーロ (フランス)				
UNIBAIL GROUP STAPLED	18.17	3,479	445,035	2.6
ICADE	5.99	492	62,975	0.4
ALTAREA	0.47	93	12,010	0.1
GECINA SA	6.451	926	118,481	0.7
KLEPIERRE	27.8	927	118,686	0.7
COVIVIO	7.26	650	83,198	0.5
MERCIALYS	7.05	108	13,895	0.1
国小計	73.191	6,679	854,282	<5.1%>
	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	7銘柄		
ユーロ (ドイツ)				
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	18.7	243	31,164	0.2
HAMBORNER REIT AG	10.68	99	12,662	0.1
国小計	29.38	342	43,826	<0.3%>
	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	2銘柄		
ユーロ (スペイン)				
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	11.97	110	14,069	0.1
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	43.16	403	51,613	0.3
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	14.09	248	31,789	0.2
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	1.29	21	2,804	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	44.69	538	68,933	0.4
国小計	115.2	1,322	169,210	<1.0%>
	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	5銘柄		
ユーロ (イタリア)				
BENI STABILI SPA	127.41	97	12,417	0.1
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6.24	45	5,785	0.0
国小計	133.65	142	18,202	<0.1%>
	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	2銘柄		
ユーロ通貨計	597.9	10,361	1,325,233	<7.9%>
	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	29銘柄		
合計	16,277.412	—	16,471,872	<97.8%>
	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	311銘柄		

(注1) 邦貨換算金額は、2018年6月15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。

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2018年6月15日現在	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
外 DJ US REIT IDXFTRS (アメリカ)	141	—
国 STOXX600 REIT IDXFTR (ドイツ)	22	—

(注1) 外貨建の評価額は、2018年6月15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。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

運用報告書 第13期（決算日 2017年11月30日）

（計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	S & P先進国REIT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REIT指数（除く日本）（円ベース））をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 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運用の効率化を図るため、不動産投資信託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資信託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。 ④保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
投資信託証券組入制限	無制限

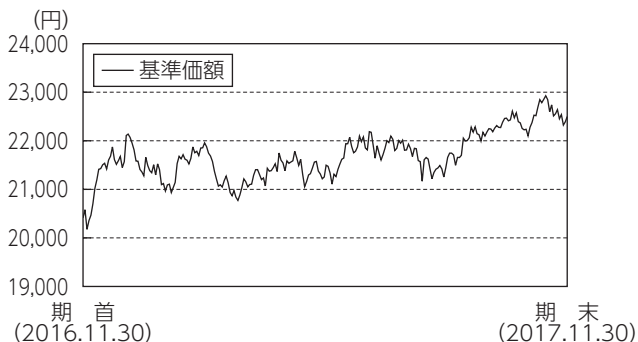
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



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

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) S & P先進国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。
 (注4) 不動産投資信託先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：20,411円 期末：22,500円 騰落率：10.2%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外リート市況

北米リート市況は、期首より、米国トランプ政権の景気刺激策への期待から緩やかな上昇となりました。2017年3月には、長期金利が上昇ペースを速めたことを受けて一時売られました。その後は、米国景気の底堅さやトランプ政権に対する政策期待などの好材料もある一方、利上げ懸念や対北朝鮮をはじめとした地政学リスクもあって方向感のない動きとなりました。期末にかけては、米国経済の先行きに楽観的な見方が強まったことや、長期金利の上昇が一服したことなどを受け、上昇して期末を迎えました。

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

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

○為替相場

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

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

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

◆前期における「今後の運用方針」

今後の運用につきましては、引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマーク（S & P先進国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。

◆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エートで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行ないました。

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

◆ベンチマークとの差異について

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

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

《今後の運用方針》

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

S & P先進国REIT指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJ」）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SPDJ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、SPDJ、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REIT指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	6円
(先物)	(0)
(投資信託受益証券)	(0)
(投資信託証券)	(5)
有価証券取引税	8
(投資信託受益証券)	(0)
(投資信託証券)	(8)
その他費用	42
(保管費用)	(43)
(その他)	(△1)
合計	55

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

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注4) 金額の単位未満は四捨五入してあります。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

当 期					期							
銘	柄	買 付			売 付			銘	柄	買 付		
		口 数	金 額	平均単価	口 数	金 額	平均単価			口 数	金 額	平均単価
VANGUARD REIT ETF (アメリカ)		千口 8.8	千円 82,211	円 9,342	VANGUARD REIT ETF (アメリカ)		千口 4	千円 37,283	円 9,320			

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は四捨五入してあります。

(2) 投資信託証券

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注4) 金額の単位未満は四捨五入してあります。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 不動産投資信託先物取引	百万円 72	百万円 -	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は四捨五入してあります。

(2) 投資信託証券

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

(1) 外国投資信託受益証券

ファンド名	当 期 末			
	口	評 価 額		比 率
		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	%
VANGUARD REIT ETF	4.8	404	45,318	0.3

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

(2) 外国投資信託証券

ファンド名	当 期 末			
	口	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)	93.103	84	9,441	0.1
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	7.1	269	30,239	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	7.7	63	7,109	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	10.882	279	31,336	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	10.9	239	26,845	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	14.2	2,584	289,645	2.2
SIMON PROPERTY GROUP INC	32.147	5,102	571,756	4.3
BOSTON PROPERTIES INC	15.9	1,988	222,788	1.7
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	16.055	711	79,676	0.6
GGP INC	63.977	1,497	167,745	1.3
VORNADO REALTY TRUST	17.664	1,358	152,263	1.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	4.5	95	10,659	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	4.6	121	13,658	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	1.6	46	5,161	0.0
QTS REALTY TRUST INC-CL A	4.8	269	30,194	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	37.8	2,522	282,676	2.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	21.4	414	46,494	0.3
EPR PROPERTIES	6.5	439	49,256	0.4
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1.7	19	2,163	0.0
CITY OFFICE REIT INC	2.1	28	3,138	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	6.333	137	15,384	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	6.329	167	18,757	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	4.5	102	11,435	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	6	173	19,409	0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	2.2	90	10,106	0.1
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5.2	361	40,471	0.3
FOREST CITY REALTY TRUST- A	27.3	668	74,883	0.6
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	10.9	214	24,060	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1.6	45	5,123	0.0
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	2.213	20	2,308	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	76.5	1,504	168,607	1.3
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	25.908	563	63,169	0.5
GRAMERCY PROPERTY TRUST	15.995	454	50,881	0.4
CORESITE REALTY CORP	3.5	394	44,174	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	15.9	565	63,406	0.5
RLJ LODGING TRUST	17.271	368	41,316	0.3
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	26	2,947	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	18	326	36,586	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3.8	59	6,625	0.0
CYRUSONE INC	9.3	557	62,513	0.5

ファンド名	当 期 末			
	口	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	%
KIMCO REALTY CORP	43.4	801	89,819	0.7
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1.8	17	1,938	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	20.45	624	70,025	0.5
WHITESTONE REIT	3	44	5,011	0.0
TIER REIT INC	4.5	89	10,064	0.1
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	0.237	2	269	0.0
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3	33	3,791	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	20.4	725	81,238	0.6
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14.4	285	32,028	0.2
QUALITY CARE PROPERTIES	9.3	137	15,422	0.1
PARK HOTELS & RESORTS INC	14.3	413	46,306	0.3
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	56.211	691	77,470	0.6
INVITATION HOMES INC	29.297	688	77,176	0.6
JBG SMITH PROPERTIES	9.232	307	34,467	0.3
ALEXANDER & BALDWIN INC	4.6	133	15,004	0.1
CLIPPER REALTY INC	1.4	14	1,600	0.0
GLADSTONE LAND CORP	0.9	12	1,357	0.0
INFRAREIT INC	3.7	78	8,830	0.1
WASHINGTON PRIME GROUP INC	18.36	134	15,017	0.1
CORECIVIC INC	11.824	276	30,935	0.2
STORE CAPITAL CORP	16.8	433	48,548	0.4
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	10	149	16,796	0.1
LIFE STORAGE INC	4.8	429	48,125	0.4
SELECT INCOME REIT	6.4	162	18,164	0.1
AMERICAN ASSETS TRUST INC	4.2	166	18,702	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	7.782	81	9,077	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUNA	3.1	67	7,520	0.1
PARAMOUNT GROUP INC	20.1	322	36,080	0.3
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	13.1	266	29,870	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	8	248	27,833	0.2
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	12.4	283	31,817	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	9.5	268	30,113	0.2
VENTAS INC	36.579	2,343	262,602	2.0
CARETRUST REIT INC	7.203	132	14,874	0.1
GEO GROUP INC/THE	12.8	339	38,079	0.3
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	30.9	563	63,153	0.5
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	9.6	178	20,050	0.2
SABRA HEALTH CARE REIT INC	17.787	343	38,485	0.3
UMH PROPERTIES INC	2.9	45	5,069	0.0
IRON MOUNTAIN INC	27.3	1,106	123,949	0.9
TERRENO REALTY CORP	5.4	203	22,786	0.2
VEREIT INC	98.808	775	86,910	0.7

ファンド名	当期			比率
	□数	評価額	金額	
	千口	外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円	%
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	46.7	395	44,268	0.3
SUN COMMUNITIES INC	8.1	750	84,144	0.6
ACADIA REALTY TRUST	8.611	246	27,643	0.2
ALEXANDER'S INC	0.4	170	19,086	0.1
PROLOGIS INC	55.046	3,640	407,883	3.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9.7	1,231	138,001	1.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	17.4	302	33,846	0.3
SAUL CENTERS INC	1	64	7,203	0.1
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	15.945	92	10,380	0.1
MACK-CALI REALTY CORP	8.5	190	21,324	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	9.4	860	96,468	0.7
COUSINS PROPERTIES INC	41.607	373	41,865	0.3
DDR CORP	31.156	243	27,299	0.2
DUKE REALTY CORP	36.5	1,045	117,173	0.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	3.4	318	35,647	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6.767	1,676	187,801	1.4
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	11.9	384	43,095	0.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7.4	977	109,533	0.8
GETTY REALTY CORP	2.803	79	8,954	0.1
WELLTOWER INC	37.9	2,549	285,717	2.1
HCP INC	48.1	1,293	144,980	1.1
HIGHWOODS PROPERTIES INC	10.6	537	60,253	0.5
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	16.9	504	56,525	0.4
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	12.3	402	45,081	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	12.375	375	42,056	0.3
KILROY REALTY CORP	10.1	762	85,398	0.6
LASALLE HOTEL PROPERTIES	11.2	316	35,452	0.3
LIBERTY PROPERTY TRUST	15	669	74,995	0.6
LTC PROPERTIES INC	4.1	190	21,302	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	22.4	234	26,278	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11.728	1,199	134,369	1.0
MACERICH CO/THE	11.2	719	80,606	0.6
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8.9	797	89,393	0.7
NATL HEALTH INVESTORS INC	4.2	329	36,876	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	15.3	632	70,923	0.5
REALTY INCOME CORP	28.317	1,570	176,001	1.3
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	10.1	308	34,573	0.3
PENN REAL ESTATE INVEST TST	6.6	79	8,903	0.1
PUBLIC STORAGE	15.4	3,238	362,818	2.7
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2	264	29,639	0.2
REGENCY CENTERS CORP	15.22	1,034	115,967	0.9
RAMCO-GERHENSEN PROPERTIES	7.3	106	11,917	0.1
ISTAR INC	6.5	75	8,404	0.1
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	9.1	228	25,603	0.2
SL GREEN REALTY CORP	10.2	1,042	116,839	0.9
SENIOR HOUSING PROP TRUST	24.1	461	51,712	0.4
TAUBMAN CENTERS INC	6.2	356	39,987	0.3
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2.5	59	6,652	0.0
UDR INC	27.7	1,090	122,164	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.1	82	9,282	0.1
WP CAREY INC	11	782	87,634	0.7
WASHINGTON REIT	7.8	252	28,308	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	12.4	409	45,850	0.3
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	8.3	54	6,147	0.0
AGREE REALTY CORP	2.6	128	14,394	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20.25	542	60,809	0.5
CUBESMART	18.5	524	58,788	0.4
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	22.326	370	41,527	0.3
DIGITAL REALTY TRUST INC	21.178	2,477	277,616	2.1
CEDAR REALTY TRUST INC	6.9	41	4,685	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	13	1,105	123,902	0.9
HERSHA HOSPITALITY TRUST	3.475	61	6,876	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	10.1	61	6,858	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	8.25	162	18,201	0.1
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	7	124	13,898	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1.5	40	4,538	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	14	594	66,622	0.5
EDUCATION REALTY TRUST INC	7.2	264	29,624	0.2
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2.5	57	6,479	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	20.442	225	25,287	0.2
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	5.249	76	8,545	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	36.9	508	57,016	0.4
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	9.7	104	11,705	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	15.5	624	69,957	0.5
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	9.5	570	63,974	0.5
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	22.9	297	33,382	0.3
アメリカ・ドル通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	2,337,492 158銘柄	84,388 9,455,753	<70.9%>

ファンド名	当期			比率
	□数	評価額	金額	
	千口	外貨建金額 千カナダ・ドル	邦貨換算金額 千円	%
(カナダ)				
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7.7	107	9,402	0.1
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	8.9	103	9,007	0.1
SLATE RETAIL REIT - U	1.7	22	1,946	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	3.5	48	4,252	0.0
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	0.7	8	719	0.0
SLATE OFFICE REIT	2.8	22	1,990	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	5.6	63	5,560	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	2.4	17	1,546	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	2.2	111	9,671	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	2.5	21	1,914	0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3.5	31	2,707	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	4.3	56	4,947	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	13.8	92	8,017	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1.7	25	2,179	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2.9	42	3,702	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	6.6	192	16,762	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	6.8	251	21,920	0.2
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	3.9	176	15,401	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	9.49	132	11,572	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	14.266	299	26,069	0.2
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	2.3	31	2,772	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16.1	400	34,861	0.3
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4.2	90	7,883	0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2	80	6,980	0.1
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	2.3	57	5,044	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3.7	50	4,434	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	4.8	199	17,408	0.1
カナダ・ドル通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	140,656 27銘柄	2,740 238,677	<1.8%>
(オーストラリア)				
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	16.89	48	4,157	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	119.72	123	10,465	0.1
RURAL FUNDS GROUP	23.54	56	4,774	0.0
VIVA ENERGY REIT	39.3	85	7,271	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	13.99	59	5,010	0.0
PROPERTYLINK GROUP	49.06	50	4,246	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	74.35	178	15,144	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	26.19	91	7,779	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	44.14	72	6,124	0.0
INDUSTRIA REIT	11.76	30	2,604	0.0
GDI PROPERTY GROUP	41.86	54	4,600	0.0
SCENTRE GROUP	553.46	2,341	198,692	1.5
ARENA REIT	27.01	67	5,730	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	10	32	2,749	0.0
BWP TRUST	45.99	146	12,412	0.1
DEXUS	105.66	1,078	91,556	0.7
GPT GROUP	184.96	989	83,981	0.6
INVESTA OFFICE FUND	50.66	239	20,336	0.2
CHARTER HALL RETAIL REIT	33.79	142	12,130	0.1
MIRVAC GROUP	381.83	931	79,070	0.6
STOCKLAND	250.6	1,172	99,536	0.7
WESTFIELD CORP	199.18	1,665	141,320	1.1
ABACUS PROPERTY GROUP	30.29	125	10,642	0.1
GOODMAN GROUP	165	1,437	121,970	0.9
VICINITY CENTRES	336.69	935	79,438	0.6
CHARTER HALL GROUP	46.45	291	24,757	0.2
INGENIA COMMUNITIES GROUP	16.33	45	3,839	0.0
オーストラリア・ドル通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	2,898.7 27銘柄	12,493 1,060,346	<8.0%>
(香港)				
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	103	535	7,685	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	91	486	6,986	0.1
FORTUNE REIT	140	1,358	19,487	0.1
PROSPERITY REIT	124	409	5,872	0.0
LINK REIT	232	16,321	234,209	1.8
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	74	256	3,674	0.0
CHAMPION REIT	196	1,136	16,313	0.1
香港ドル通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	960 7銘柄	20,503 294,227	<2.2%>
(シンガポール)				
KEPPEL DC REIT	74.028	106	8,868	0.1
FIRST REAL ESTATE INVST TRUST	53.4	73	6,086	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	175.5	203	16,935	0.1
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	48.9	66	5,532	0.0
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	120.3	129	10,808	0.1
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	269.975	502	41,774	0.3
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	251.3	660	54,981	0.4
CAPITALAND MALL TRUST	274.5	565	47,041	0.4

ファンド名	当 期 末			比 率
	口 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
SUNTEC REIT	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	229.3	458	38,150	0.3
KEPPEL REIT	211.9	266	22,211	0.2
FRASERS COMMERCIAL TRUST	184.7	230	19,206	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	52.76	75	6,320	0.0
ESR-REIT	134.3	158	13,183	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	84,479	47	3,970	0.0
FRASERS CENTREPOINT TRUST	76.4	124	10,359	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	54.4	120	10,001	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	126.9	96	8,023	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	51.1	84	7,014	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	36.3	103	8,636	0.1
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	165.2	68	5,703	0.0
CACHE LOGISTICS TRUST	119.38	235	19,564	0.1
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	100.2	86	7,168	0.1
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	190.6	297	24,735	0.2
SPH REIT	70.2	50	4,204	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	70.5	74	6,158	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	64.9	42	3,536	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	78.1	32	2,696	0.0
QUE HOSPITALITY TRUST	64.2	53	4,486	0.0
シンガポール・ドル通貨計	3,530,395	5,096	423,954	< 3.2%>
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
STRIDE PROPERTY GROUP	29.16	51	3,980	0.0
INVESTORE PROPERTY LTD	10.25	14	1,108	0.0
ARGOSY PROPERTY LTD	71.63	75	5,767	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD	145.35	198	15,213	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	25.97	57	4,371	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	107.55	146	11,215	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	100.59	132	10,181	0.1
ニュージーランド・ドル通貨計	490.5	676	51,837	< 0.4%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	185.42	109	16,473	0.1
CAPITAL & REGIONAL PLC	41.94	21	3,231	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	51.71	46	6,918	0.1
REGIONAL REIT LTD	26.15	27	4,088	0.0
NEWRIVER REIT PLC	31.4	99	14,939	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	13.45	15	2,259	0.0
LXI REIT PLC	11.54	12	1,804	0.0
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	7.57	7	1,165	0.0
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	110.39	41	6,166	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	77.831	723	108,813	0.8
HANSTEEN HOLDINGS PLC	42.78	58	8,862	0.1
SEGRO PLC	104.09	571	85,984	0.6
HAMMERSON PLC	82.18	424	63,809	0.5
UNITE GROUP PLC	24.52	176	26,466	0.2
BRITISH LAND CO PLC	108.08	674	101,385	0.8
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	32.79	200	30,068	0.2
INTU PROPERTIES PLC	87.71	170	25,672	0.2
DERWENT LONDON PLC	11.52	313	47,122	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	56.76	65	9,812	0.1
WORKSPACE GROUP PLC	12.28	114	17,195	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	20.18	93	14,045	0.1
SHAFTESBURY PLC	23.03	227	34,188	0.3
BIG YELLOW GROUP PLC	15.46	129	19,406	0.1
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	70.52	126	19,082	0.1
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	43.33	26	3,940	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	141.22	205	30,825	0.2
(非上場)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC-ENT	33.712	-	-	-
イギリス・ポンド通貨計	1,467,563	4,681	703,728	< 5.3%>
(イスラエル)	千口	千イスラエル・シケル	千円	%
REIT 1 LTD	9.34	140	4,480	0.0
イスラエル・シケル通貨計	9.34	140	4,480	< 0.0%>
ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	33.1	49	6,545	0.0
GREEN REIT PLC	66.56	99	13,171	0.1
HIBERNIA REIT PLC	70.99	100	13,340	0.1
国 小 計	170.65	248	33,057	< 0.2%>
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千円	%
WERELDHAVE NV	4.15	161	21,473	0.2

ファンド名	当 期 末			比 率
	口 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	千口	千ユーロ	千円	%
NSI NV	5.01	177	23,574	0.2
VASTNED RETAIL NV	1.731	58	7,793	0.1
国 小 計	12,371	456	60,683	< 0.5%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千円	%
AEDIFICA	1.808	144	19,221	0.1
COFINIMMO	1.97	212	28,282	0.2
BEFIMMO	2.31	123	16,425	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	1.23	27	3,609	0.0
RETAIL ESTATES	0.5	36	4,801	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA	1.67	151	20,089	0.2
国 小 計	9,488	695	92,430	< 0.7%>
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO SE	10.4	2,260	300,278	2.3
ICADE	4.69	369	49,095	0.4
ALTAREA	0.35	67	8,989	0.1
GECINA SA	4.831	672	89,311	0.7
KLEPIERRE	21.62	748	99,377	0.7
FONCIERE DES REGIONS	5.48	489	64,992	0.5
MERCIALYS	5.66	98	13,109	0.1
国 小 計	53,031	4,707	625,154	< 4.7%>
ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	12.69	158	21,007	0.2
HAMBORNER REIT AG	8.12	78	10,409	0.1
国 小 計	20.81	236	31,417	< 0.2%>
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	9.6	79	10,592	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	11.17	164	21,799	0.2
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	6.96	127	16,906	0.1
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	34.56	379	50,374	0.4
国 小 計	62.29	750	99,673	< 0.7%>
ユーロ (イタリア)	千口	千ユーロ	千円	%
BENI STABILI SPA	94.42	71	9,524	0.1
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	30.4	32	4,356	0.0
国 小 計	124.82	104	13,880	< 0.1%>
ユーロ通貨計	453.46	7,200	956,298	< 7.2%>
合 計	12,288,106	-	13,189,304	< 9.9%>

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国	百万円	百万円
DJ US REIT IDXFTRS (アメリカ)	72	-

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

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 45,318	% 0.3
投資信託証券	13,189,304	98.4
コール・ローン等、その他	172,362	1.3
投資信託財産総額	13,406,985	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.05円、1カナダ・ドル=87.10円、1オーストラリア・ドル=84.87円、1香港ドル=14.35円、1シンガポール・ドル=83.19円、1ニュージーランド・ドル=76.68円、1イギリス・ポンド=150.33円、1イスラエル・シケル=31.98円、1ユーロ=132.81円です。
 (注3) 当期末における外貨建純資産（13,288,169千円）の投資信託財産総額（13,406,985千円）に対する比率は、99.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

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

*期首における元本額は2,563,048,197円、当期中における追加設定元本額は3,788,132,970円、同解約元本額は423,335,847円です。
 *当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）3,020,027,986円、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）385,272,511円、ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）197,879,052円、ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）138,768,817円、D-1's グローバルREITインデックス1,191,716円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 28,535円、iFree 外国REITインデックス61,854,354円、iFree 8資産バランス305,935,202円、DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド1,494,626,508円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 3,528,717円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 6,075,115円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 1,124,043円、ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT 280,050,632円、ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド22,439,317円、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）4,479,909円、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）4,562,906円です。
 *当期末の計算口数当りの純資産額は22,500円です。

■損益の状況

当期 自2016年12月1日 至2017年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	373,343,266円
受取配当金	373,355,931
受取利息	27,447
支払利息	△ 40,112
(B) 有価証券売買損益	485,032,529
売買益	900,668,253
売買損	△ 415,635,724
(C) 先物取引等損益	392,175
取引益	392,175
(D) その他費用	△ 19,421,346
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	839,346,624
(F) 前期繰越損益金	2,668,328,775
(G) 解約差損益金	△ 499,757,653
(H) 追加信託差損益金	4,401,912,030
(I) 合計(E+F+G+H)	7,409,829,776
次期繰越損益金(I)	7,409,829,776

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

《お知らせ》
 ■先物取引の利用について
 不動産投信指数先物取引を利用できるように約款を変更しました。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主投資対象	ベビーファンド	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）
マザーファンドの運用方法	<p>①主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>④保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。</p>	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

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

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス （為替ヘッジなし）

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2018年6月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）」は、このたび、第2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/>

<2737>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	不動産投資 指数 先物比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率					
1期末(2017年6月15日)	円	円	%	円	%	%	%	%	百万円
1期末(2017年6月15日)	10,729	0	7.3	10,780	7.8	—	99.1	—	609
2期末(2018年6月15日)	10,864	0	1.3	11,093	2.9	0.8	97.8	1.0	1,189

(注1) S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。同指数は、S & P ダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & P グローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

(注2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

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

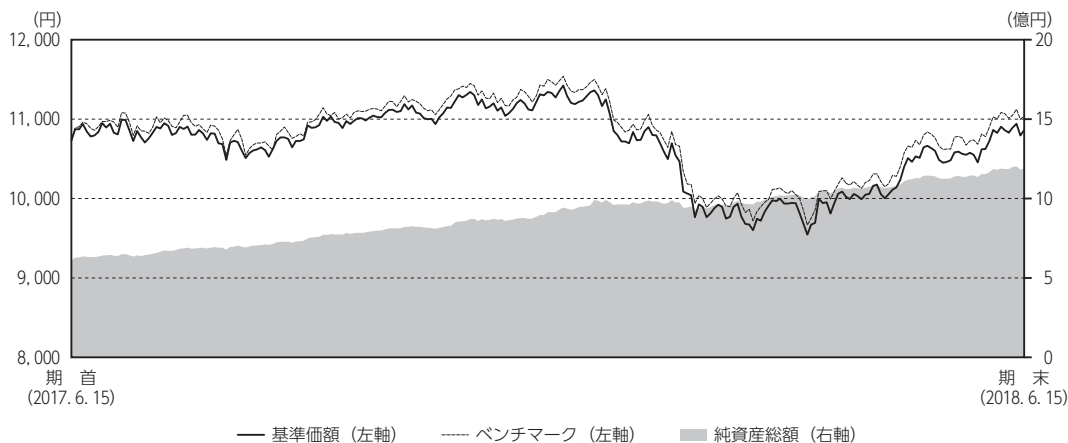
(注4) 不動産投資指数先物比率は買建比率-売建比率です。

S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (「当インデックス」) はS&P Dow Jones Indices LLC (「SPDJI」) の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor's® 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SPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国REIT指数 (除く日本) の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークはS & P 先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) です。

■ 基準価額・騰落率

期首：10,729円

期末：10,864円

騰落率：1.3%

■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、主要通貨が円に対して上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首)2017年6月15日	円	%	(ベンチマーク)	%	%	%	%
	10,729	—	10,780	—	—	99.1	—
6月末	10,828	0.9	11,013	2.2	—	99.1	—
7月末	10,803	0.7	11,007	2.1	0.3	99.1	—
8月末	10,726	△ 0.0	10,855	0.7	0.2	99.0	—
9月末	10,980	2.3	11,137	3.3	0.6	98.2	—
10月末	10,937	1.9	11,109	3.0	0.4	98.7	0.6
11月末	11,128	3.7	11,294	4.8	0.3	98.9	0.5
12月末	11,362	5.9	11,553	7.2	1.0	97.0	1.2
2018年1月末	10,497	△ 2.2	10,695	△ 0.8	1.0	97.7	1.2
2月末	9,772	△ 8.9	9,975	△ 7.5	0.6	98.1	1.1
3月末	9,942	△ 7.3	10,147	△ 5.9	0.8	97.7	1.0
4月末	10,235	△ 4.6	10,448	△ 3.1	0.8	97.8	1.0
5月末	10,620	△ 1.0	10,865	0.8	0.7	97.7	1.0
(期末)2018年6月15日	10,864	1.3	11,093	2.9	0.8	97.8	1.0

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 6. 16 ~ 2018. 6. 15)

■海外リート市況

米国リート市況は、期首より、米国景気の底堅さやトランプ政権に対する政策期待などの好材料がある一方、利上げ懸念や北朝鮮をはじめとした地政学リスクもあって、方向感のない動きとなりました。しかし2018年に入ると、好調な経済指標の発表により早期利上げ観測が高まったことから長期金利が上昇し、利回り資産としてのリートに売り圧力が強まりました。期末にかけては、主要リーートの好調な決算発表を受けやや値を戻しました。カナダリート市況は、期を通じて緩やかな上昇となりました。

欧州リート市況は、期首より、ドイツなどで長期金利が上昇に転じたことや、フランス大手リーートの増資発表が悪材料となり、上値が重い展開となりました。その後は、長期金利の影響を受ける一進一退の値動きとなりました。2017年11月から12月にかけては、好調な不動産ファンダメンタルズや大手商業施設リートに対する買収観測などが好材料となり、フランスやドイツを中心として総じて堅調に推移しました。2018年に入ると、堅調な景気を受けた長期金利の上昇や米国株式の急落から売られる展開となりましたが、期末にかけては急落の反動で緩やかな上昇に転じました。

アジア・オセアニアリート市況は、香港およびシンガポールは、期首から、自国金利が低下に転じたことや中国政府への政策期待などにより、上昇しました。2017年8月以降は、アジアでは小動きの展開となりましたが、11月からは、一部リーートの好決算や世界的な景気見通しの改善などを反映し、上昇しました。2018年に入ると、他地域と同様に下落基調となりましたが、期末にかけて香港は再び上昇しました。オーストラリアは、期首から商業施設セクターを中心に売られましたが、その後はアジア地域と似た値動きとなりました。

■為替相場

為替相場は、期を通して、米ドルやユーロなどの主要通貨が対円で上昇しました。期首より、ECB（欧州中央銀行）の金融緩和姿勢の後退がユーロなどの上昇要因となりました。2017年9月に入ると、FOMC（米国連邦公開市場委員会）で2017年内の追加利上げの可能性が示唆されたことなどから円安傾向となりました。その後、主要通貨はおおむね横ばいで推移しましたが、2018年に入ると、米国のムニューシン財務長官による米ドル安容認発言などから米ドルが下落しました。2月には、米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことや各国の株価が急落したことなどから市場のリスク回避姿勢が強まり、円は上昇傾向となりました。4月以降は、米国の金利が上昇したことなどから米ドルなどが上昇しました。一方、ユーロなどはイタリア情勢の影響から下落しました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■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（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98%以上で運用を行ないます。

ポートフォリオについて

（2017. 6. 16～2018. 6. 15）

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行ないました。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

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

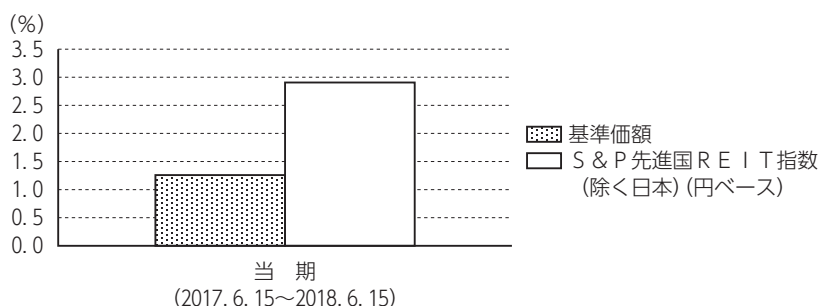
ベンチマークとの差異について

当期のベンチマーク（S & P 先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））の騰落率は2.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は1.3%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年6月16日 ～2018年6月15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)	864

- (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

主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■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、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ETF）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2017. 6. 16~2018. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	46円	0.427%	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10,670円です。
(投信会社)	(32)	(0.297)	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)	(12)	(0.108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	2	0.019	売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数 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
(先物)	(0)	(0.002)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(2)	(0.017)	
有価証券取引税	3	0.028	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
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(3)	(0.028)	
その他費用	13	0.125	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)	(12)	(0.112)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(1)	(0.008)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	64	0.599	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口数	金額	口数	金額
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	266,833	577,094	8,500	18,465

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	281,704	540,038	1,188,948

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項目	当 期 末	
	評価額	比率
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	1,188,948	98.7
コール・ローン等、その他	15,677	1.3
投資信託財産総額	1,204,625	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.68円、1カナダ・ドル=84.33円、1オーストラリア・ドル=82.53円、1香港ドル=14.10円、1シンガポール・ドル=82.20円、1ニュージーランド・ドル=76.93円、1イギリス・ポンド=146.66円、1イスラエル・シケル=30.62円、1ユーロ=127.90円です。

(注3) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(16,700,675千円)の投資信託財産総額(16,888,374千円)に対する比率は、98.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項目	当期末
(A) 資産	1,204,625,883円
コール・ローン等	9,337,637
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)	1,188,948,246
未収入金	6,340,000
(B) 負債	15,497,992
未払解約金	13,274,604
未払信託報酬	2,195,646
その他未払費用	27,742
(C) 純資産総額 (A - B)	1,189,127,891
元本	1,094,522,792
次期繰越損益金	94,605,099
(D) 受益権総口数	1,094,522,792口
1万口当り基準価額 (C / D)	10,864円

*期首における元本額は568,394,416円、当期中における追加設定元本額は637,956,340円、同解約元本額は111,827,964円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は10,864円です。

■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	16,713,215
(c) 収益調整金	60,595,866
(d) 分配準備積立金	17,296,919
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	94,606,000
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	94,606,000
(h) 受益権総口数	1,094,522,792口

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 901円
受取利息	47
支払利息	△ 948
(B) 有価証券売買損益	20,567,680
売買益	22,716,726
売買損	△ 2,149,046
(C) 信託報酬等	△ 3,854,330
(D) 当期損益金 (A + B + C)	16,712,449
(E) 前期繰越損益金	17,296,784
(F) 追加信託差損益金	60,595,866
(配当等相当額)	(20,832,075)
(売買損益相当額)	(39,763,791)
(G) 合計 (D + E + F)	94,605,099
次期繰越損益金 (G)	94,605,099
追加信託差損益金	60,595,866
(配当等相当額)	(20,832,075)
(売買損益相当額)	(39,763,791)
分配準備積立金	34,010,134
繰越損益金	△ 901

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程 (総額)」の表をご参照ください。

《お知らせ》

■マザーファンドにおける先物取引の利用について

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

★「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の第13期にかかる運用状況については246～251ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド(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))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(2017年11月30日)と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日(2018年6月15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掲載いたしました。240～245ページをご参照ください。