

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	TOPIX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-REITインデックス
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)
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1期

(決算日 2017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1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先 (コールセンター)

TEL 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

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

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1期

（決算日 2017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1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00~17:00）

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

<4641>

設定以来の運用実績

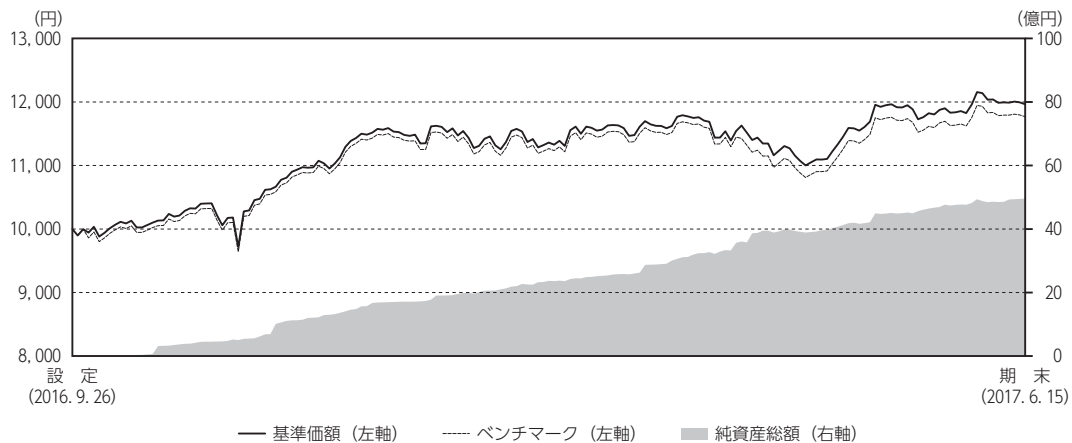
決算期	基準価額		TOPIX		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額	
	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
1 期末(2017年 6月15日)	円 11,964	円 0	% 19.6	(ベンチマーク) 1,588.09	% 17.7	% 98.8	% 1.2	百万円 4,959

(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、設定時を10,000として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

設定時：10,000円

期末：11,964円

騰落率：19.6%

■ 基準価額の主な変動要因

米国の経済政策への期待や地政学リスクの落ち着きから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。

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		
(設定) 2016年 9月26日	10,000	—	(9/23) 1,349.56	—	—	—
9月末	9,882	△ 1.2	1,322.78	△ 2.0	98.5	1.5
10月末	10,402	4.0	1,393.02	3.2	98.6	1.4
11月末	10,971	9.7	1,469.43	8.9	99.0	0.9
12月末	11,350	13.5	1,518.61	12.5	99.3	0.6
2017年 1月末	11,370	13.7	1,521.67	12.8	99.4	0.5
2月末	11,478	14.8	1,535.32	13.8	99.5	0.7
3月末	11,401	14.0	1,512.60	12.1	97.4	2.5
4月末	11,548	15.5	1,531.80	13.5	98.4	1.7
5月末	11,825	18.3	1,568.37	16.2	98.6	1.3
(期末) 2017年 6月15日	11,964	19.6	1,588.09	17.7	98.8	1.2

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2016. 9. 26 ~ 2017. 6. 15)

国内株式市況

国内株式市況は、設定時より、国内の財政・金融政策への期待を受けて上昇して始まりました。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、上昇基調で推移しました。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、株価は一進一退で推移しました。2017年4月に入ると、東アジアの地政学リスクの高まりが懸念され、株価は下落しました。しかし4月後半からは、地政学リスク悪化の一巡に加えて、フランス大統領選挙で中道派のマクロン氏が極右政党の候補者を抑えて当選したことが好感され、株価は上昇しました。

ポートフォリオについて

(2016. 9. 26 ~ 2017. 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」の受益証券を通じて行ないました。

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

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

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

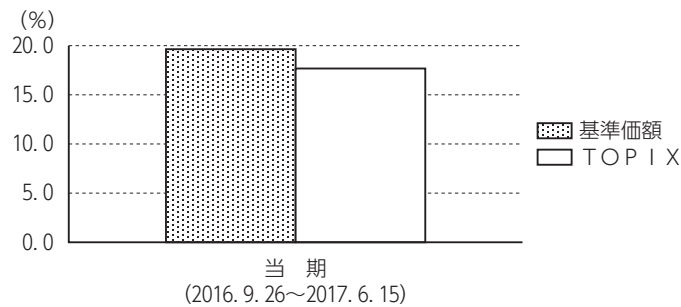
ベンチマークとの差異について

当期のベンチマーク（TOPIX）の騰落率は17.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は19.6%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	
	2016年9月26日 ～2017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)	1,964

- (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（TOPIX）に連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2016.9.26~2017.6.15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	27円	0.241%	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11,236円です。
(投 信 会 社)	(17)	(0.148)	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)	(9)	(0.078)	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)	(0.015)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先 物)	(0)	(0.001)	
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)	(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	28	0.247	

(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立・解約状況

(2016年9月26日から2017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
トピックス・インデックス・マザーファンド	5,191,615	4,762,242	112,468	108,914

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2016年9月26日から2017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	15,716,232千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	123,583,507千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.12

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2016年9月26日から2017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
株式	百万円 4,530	百万円 —	% —	百万円 11,186	百万円 40	% 0.4
株式先物取引	12,930	—	—	12,093	—	—
コール・ローン	1,054,067	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合1.8%

※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

(2016年9月26日から2017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
株式	百万円 10	百万円 26	百万円 330

(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

(2016年9月26日から2017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
株式	百万円 4

(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、マネーパートナーズグループです。

■ 投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	1	—	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。
(注2) 単位未満は切捨て。

■ 組入資産明細表
親投資信託残高

種類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	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	4,959,279

(注) 単位未満は切捨て。

■ 投資信託財産の構成

2017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	4,959,279	99.9
コール・ローン等、その他	6,016	0.1
投資信託財産総額	4,965,296	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6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,965,296,746円
コール・ローン等	6,016,899
トピックス・インデックス・マザーファンド (評価額)	4,959,279,847
(B) 負債	5,967,899
未払解約金	2,742,077
未払信託報酬	3,173,687
その他未払費用	52,135
(C) 純資産総額 (A - B)	4,959,328,847
元本	4,145,077,773
次期繰越損益金	814,251,074
(D) 受益権総口数	4,145,077,773口
1万口当り基準価額 (C / D)	11,964円

* 設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は4,454,641,067円、同解約元本額は310,563,294円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,964円です。

■ 損益の状況

当期 自2016年9月26日 至2017年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,467円
受取利息	48
支払利息	△ 1,515
(B) 有価証券売買損益	286,644,737
売買益	305,964,101
売買損	△ 19,319,364
(C) 信託報酬等	△ 5,916,517
(D) 当期損益金 (A + B + C)	280,726,753
(E) 追加信託差損益金	533,524,321
(配当等相当額)	(△ 497)
(売買損益相当額)	(533,524,818)
(F) 合計 (D + E)	814,251,074
次期繰越損益金 (F)	814,251,074
追加信託差損益金	533,524,321
(配当等相当額)	(△ 497)
(売買損益相当額)	(533,524,818)
分配準備積立金	280,728,220
繰越損益金	△ 1,467

(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	280,728,220
(c) 収益調整金	533,524,818
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	814,253,038
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	814,253,038
(h) 受益権総口数	4,145,077,773口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ TOPIX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（2016年9月20日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017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 株 式

(2016年9月26日から2017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
九州旅客鉄道	58.2	182,226	3,131	ソフトバンクグループ	78.1	535,352	6,854
日本電信電話	26.5	124,000	4,679	トヨタ自動車	64	421,293	6,582
東日本旅客鉄道	8.4	78,783	9,379	東 芝	1,322	319,713	241
デンソー	16.1	72,256	4,488	三菱UFJフィナンシャルG	448.9	284,668	634
日本電産	6.8	70,031	10,298	みずほフィナンシャルG	759.9	147,519	194
野村ホールディングス	111.1	60,847	547	日産自動車	130.3	139,824	1,073
キャノン	13.5	43,605	3,230	日本電信電話	24.9	121,729	4,888
リクルートホールディングス	10	42,530	4,253	武田薬品	24.1	118,908	4,933
本田技研	12.8	40,672	3,177	本田技研	32.7	107,841	3,297
スズキ	10.6	39,673	3,742	アステラス製薬	67	104,557	1,560

(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、2017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（134,029,657千円）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2017年6月15日現在		銘柄	2017年6月15日現在		銘柄	2017年6月15日現在		銘柄	2017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%)			新日本建設	7.9	7,655	中部飼料	8.5	12,384	フジッコ	6.4	16,825
極洋	3.2	9,952	NIPPPO	13	29,302	フィード・ワン	47	10,716	ロックフィールド	7.5	14,812
日本水産	85.2	58,873	東亜道路	20	9,560	日本甜菜糖	2.4	5,265	日本たばこ産業	347.6	1,423,769
マルハニチロ	12	37,860	前田道路	18	40,266	三井製糖	4.5	14,625	ケンコーマヨネーズ	3.7	11,729
カネコ種苗	3.1	4,526	日本道路	18	10,422	塩水港精糖	22.6	5,627	わらべや日洋HD	4	12,440
サカタのタネ	9	30,600	東亜建設	6.7	12,321	日新製糖	0.3	553	ユーグレナ	20.4	23,806
ホクト	6.6	13,107	若菜建設	57	9,576	森永製菓	12.5	90,000	ミヨシ油脂	61	8,845
鉱業 (0.3%)			東洋建設	20.7	8,838	中村屋	2.1	10,479	理研ビタミン	1.4	6,237
日鉄鉱業	1.8	10,278	五洋建設	69.6	45,657	江崎グリコ	15.8	101,594	繊維製品 (0.7%)		
三井松島	6.7	9,045	大林道路	8	7,504	不二家	39	10,023	片倉工業	7.9	10,428
国際石油開発帝石	333.9	347,923	世紀東急	16.8	9,626	山崎製パン	46.1	109,533	グンゼ	44	17,160
日本海洋掘削	2.4	5,246	福田組	10	10,720	モロゾフ	19	12,160	東洋紡	238	48,314
石油資源開発	9.5	21,432	住友林業	40.8	72,828	亀田製菓	3.7	21,349	ユニチカ	219	17,958
K&O エナジーグループ	4	7,300	日本基礎技術	11.9	4,414	寿スピリッツ	6	23,790	富士紡ホールディングス	3.6	11,520
建設業 (3.2%)			日成ビルド工業	19	12,084	カルビー	25.7	116,935	倉敷紡績	47	12,126
ショーボンドHD	6.3	36,162	パナホーム	5	6,005	森永乳業	60	55,860	シキボウ	63	8,946
ミライト・ホールディングス	19.2	22,675	大和ハウス	183.2	697,808	六甲バター	3.2	8,675	日本毛織	10.9	9,701
タマホーム	13.3	8,538	ライト工業	12.3	15,288	ヤクルト	33.9	268,827	ダイドーリミテッド	24.3	10,570
安藤・間	45.6	33,151	積水ハウス	184.3	364,361	明治ホールディングス	37.2	344,844	帝国繊維	6.4	11,763
東急建設	22.7	21,474	ユアテック	8	5,976	雪印メグミルク	13.7	46,648	帝人	47.7	99,693
コムシホールディングス	24.3	57,080	西部電気工業	3.2	7,286	プリマハム	41	26,240	東レ	425.2	387,782
ミサワホーム	11.1	11,255	中電工	5.4	15,384	日本ハム	44	159,940	サカイ オーベックス	3.3	5,613
高松コンストラクショング	4.6	12,852	関電工	25	29,025	丸大食品	30	15,780	住江織物	21	5,292
東建コーポレーション	2.4	29,736	きんでん	41.2	71,358	S Foods	3.2	12,784	アツギ	74	9,102
大成建設	321	329,346	東京エネシス	6.7	6,525	伊藤ハム米久HLDGS	36.5	39,091	セーレン	14.9	25,836
大林組	188.6	247,820	トーエネック	8	5,496	サッポロホールディングス	21.1	69,419	ソトー	6.1	6,960
清水建設	193	226,196	住友電設	4.8	7,560	アサヒグループホールディング	118.4	519,420	東海染工	53	7,102
飛鳥建設	70.3	11,880	日本電設工業	10	22,900	キリンHD	270.5	664,753	小松精練	11.9	8,758
長谷工コーポレーション	73.9	110,406	協和エクシオ	24.3	46,437	宝ホールディングス	44.6	54,099	ワコールホールディングス	29	42,340
松井建設	8.2	7,273	九電工	12.4	51,832	オノンホールディングス	31	8,556	ホギメディカル	3.7	29,341
鹿島建設	277	255,394	三機工業	13.4	15,731	コカ・コーラボトラーズJ	39.6	129,690	TSJホールディングス	23	17,848
不動テトラ	56.6	10,301	日揮	59.1	102,538	サントリー食品インター	43.1	232,740	三陽商会	56	9,800
鉄建建設	41	14,391	中外炉工業	29	6,264	ガイドグループHD	2.7	15,363	オンワードホールディングス	37	30,007
西松建設	73	44,968	太平電業	8	10,352	伊藤園	18.7	81,251	ゴールドウイン	2.6	17,758
三井住友建設	235.7	28,991	高砂熱学	16.6	29,299	キーコーヒー	6.2	13,584	デサント	12.6	18,345
大豊建設	24	13,512	明星工業	13.4	8,549	日清オイログループ	35	22,785	パルプ・紙 (0.3%)		
前田建設	41	53,095	大気社	7.2	21,304	不二製油グループ	16.8	44,839	特種東海製紙	3	12,150
奥村組	47	35,814	ダイダン	9	11,304	J-オイルミルズ	1.8	7,245	王子ホールディングス	216	123,336
東鉄工業	7.7	26,680	日比谷総合設備	4.4	7,990	キッコーマン	43.1	158,177	日本製紙	25.5	57,298
浅沼組	23	7,544	東芝プラントシステム	10.5	18,532	味の素	130.1	321,086	三菱製紙	11.4	8,664
戸田建設	74	52,540	OSJBHD	27.2	7,561	キューピー	32.5	94,900	北越紀州製紙	31.9	28,710
熊谷組	101	36,360	東洋エンジニア	37	9,916	ハウス食品G本社	22.6	67,461	中越パルプ	27	6,507
北野建設	18	5,796	千代田化工建	46	29,624	カゴメ	23	83,605	巴川製紙	30	7,260
三井ホーム	12	8,856	新興プランテック	14	11,774	アリアケジャパン	5.2	42,380	大王製紙	24.1	36,125
矢作建設	9.7	8,894	食料品 (4.8%)			ニチレイ	31	104,780	レンゴー	58.6	37,562
ピーエス三菱	16	8,064	日本製粉	17.1	30,780	東洋水産	30.5	133,437	トーモク	2.9	9,000
日本ハウスHLDGS	17.4	9,204	日清製粉G本社	67.7	129,713	日清食品HD	24.4	174,948	ザ・バック	3.4	13,611
大東建託	22.8	407,094	昭和産業	24	14,760	永谷園ホールディングス	8	11,344			

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第28期 (決算日 2016年9月20日)

(計算期間 2016年5月10日～2016年9月20日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

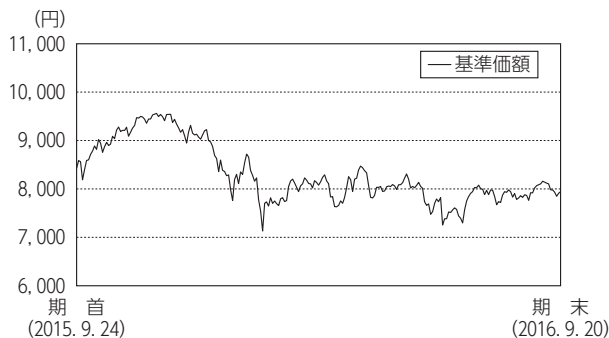
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年月日	基準価額		TOPIX (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	円	%	円	%		
(期首)2015年9月24日	8,429	—	1,426.97	—	99.1	0.9
9月末	8,400	△ 0.3	1,411.16	△ 1.1	98.0	2.0
10月末	9,275	10.0	1,558.20	9.2	98.5	1.6
11月末	9,409	11.6	1,580.25	10.7	99.1	1.0
12月末	9,225	9.4	1,547.30	8.4	98.7	1.3
2016年1月末	8,539	1.3	1,432.07	0.4	98.0	2.1
2月末	7,739	△ 8.2	1,297.85	△ 9.0	98.8	1.4
3月末	8,110	△ 3.8	1,347.20	△ 5.6	98.1	1.9
4月末	8,068	△ 4.3	1,340.55	△ 6.1	98.6	1.5
5月末	8,310	△ 1.4	1,379.80	△ 3.3	98.3	1.7
6月末	7,513	△ 10.9	1,245.82	△ 12.7	98.3	1.8
7月末	7,979	△ 5.3	1,322.74	△ 7.3	99.1	0.8
8月末	8,020	△ 4.9	1,329.54	△ 6.8	99.3	0.7
(期末)2016年9月20日	7,944	△ 5.8	1,316.97	△ 7.7	99.7	0.2

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式先物比率は買建比率 - 売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：8,429円 期末：7,944円 騰落率：△5.8%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、世界経済の先行き不透明感や円高の進行などで下落しましたが、2015年10月に入ると、世界経済に対する過度な不安感が後退したことやECB（欧州中央銀行）が追加金融緩和を示唆したこと、中国が追加金融緩和を実施したことなどで上昇しました。12月以降は、ECBの追加金融緩和策への失望や原

油価格の下落、中国・人民元安と中国株安、円高などにより株価は下落しました。2016年1月末には、日銀がマイナス金利を導入し一時的に株価は上昇しましたが、その後は米国経済および中国経済への懸念や欧州金融機関への信用不安などで下落しました。2月後半からは、米国の製造業関連指標の回復や中国およびECBの金融緩和などにより株価は反発しましたが、3月後半以降は、日米金融政策や米国為替政策への懸念から為替相場が不安定になり、株価も乱高下しました。6月には、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱支持が多数だったことを受けて株価は下落しましたが、7月以降は、国内の財政・金融政策への期待や円高傾向の一服などから上昇しました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

・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、売買コスト等が乖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	—
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方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

(2015年9月25日から2016年9月20日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株式

(2015年9月25日から2016年9月20日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期 首			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																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																															
水産・農林業 (0.1%)	千株	千株	千円	前田道路	20	19	34,276	中村屋	23	23	10,373	極洋	37	35	9,485	日本道路	21	20	7,860	江崎グリコ	14.7	15.1	82,899	日本水産	86.2	77.9	34,509	東亜建設	53	61	10,797	不二家	43	51	10,200	マルハニチロ	15.3	14	34,692	若築建設	44	92	13,248	山崎製パン	46	48.4	119,257	サカタのタネ	11	10.7	27,552	東洋建設	20.6	22.4	9,497	第一屋製パン	—	44	5,500	ホクト	7.5	7	12,558	五洋建設	72.4	73.1	39,766	モロゾフ	24	21	9,051	日鉄鉱業 (0.3%)	23	20	7,760	大林道路	9	9.1	5,651	亀田製菓	3.8	3.9	20,436	三井松島	66	57	6,840	世紀東急	12.3	13.3	6,809	寿スピリッツ	2.2	5.7	13,149	国際石油開発帝石	333.5	338.9	280,168	福田組	11	12	12,468	カルビー	23.4	24.1	91,459	日本海洋掘削	2.2	2.5	5,552	住友林業	47	44.6	59,808	森永乳業	60	59	44,368	石油資源開発	9.1	10.2	21,205	日本基礎技術	5.2	26.2	8,515	六甲バター	1.7	4	11,488	K&O エナジーグループ	5.2	5.1	7,007	日成ビルド工業	24	22	10,208	ヤマト・エスバイエルホーム	52	—	—	ヤクルト	33.9	33.3	167,498	建設業 (3.1%)	6	6.8	31,042	パナホーム	25	25	19,600	雪印メグミルク	15.4	15.7	54,243	ショールドHD	20.7	20.4	17,748	大和ハウス	186.9	193	513,283	ブリマハム	41	46	16,376	ミライト・ホールディングス	44.4	44.7	27,267	ライト工業	11.2	13.4	15,624	日本ハム	47	47	113,975	安藤・間	23.9	22	21,538	積水ハウス	199	217.3	363,434	伊藤ハム	36	—	—	東急建設	28.5	27.1	49,836	日特建設	11.2	18.6	8,872	丸大食品	37	36	17,280	コムシホールディングス	9.5	8.9	6,764	ユアテック	12	12	6,360	米久	1.4	—	—	ミサワホーム	5.3	4.8	11,092	中電工	9.7	7.5	14,865	S Foods	4.9	4.6	12,084	高松コンストラクションGP	2.7	2.8	20,888	関電工	29	26	23,842	伊藤ハム米久HLDGS	—	41.9	42,360	東建コーポレーション	328	340	258,400	ぎんでん	40.7	35.1	39,768	サッポロホールディングス	108	20.2	55,388	大成建設	190	196	193,256	東京エネクス	6	8	7,624	アサヒグループホールディングス	118.9	122.7	436,443	大林組	193	199	177,110	トーエネック	12	11	5,225	キリンHD	256.4	281	457,889	清水建設	46.7	62	10,726	住友電設	6.1	6	6,210	宝ホールディングス	51.9	47.3	44,083	飛鳥建設	79.8	76.8	71,961	日本電設工業	10.6	9.9	17,641	オノンホールディングス	35	60	13,200	長谷工コーポレーション	11	10.3	11,433	協和エクシオ	26.7	25.3	36,583	ココ・コーラウエスト	21.1	22.1	55,338	松井建設	7	18	6,246	九電工	12	12.2	41,236	ココ・コーライーストジャパン	22.1	23.2	45,286	銭高組	277	306	213,588	三機工業	13.9	14.3	11,954	サントリー食品インターナショナル	42.8	45.5	192,010	鹿島建設	52.8	51.3	8,669	日揮	64	65	109,785	ダイドードリンコ	3.2	3.4	18,564	不動テトラ	42	43	13,416	日輝	28	34	6,766	伊藤園	18.4	19.3	65,330	鉄建建設	70	75	34,350	中外炉工業	10	10	9,590	キーコーヒー	6.4	6.7	12,750	西松建設	264	255.1	24,744	高砂熱学	17.7	18.6	27,583	日清オイリオグループ	35	36	16,488	三井住友建設	19	27	14,553	明星工業	14	13.9	6,463	不二製油グループ	17.1	17.5	34,790	大豊建設	43	40	33,360	大気社	9.5	7.4	18,352	J-オイルミルズ	33	32	11,296	前田建設	3.5	15.2	5,973	ダイダ	11	10	7,830	キッコーマン	52	49	156,800	ナカノフード建設	60	58	32,422	日比谷総合設備	9	8.6	14,052	味の素	146	138.1	307,134	東鉄工業	8.1	8	22,392	東芝プラントシステム	10.1	9.9	15,780	キューピー	32	33.9	102,039	浅沼組	17	37	7,992	東洋エンジニア	33	35	10,885	ハウス食品G本社	23.1	21.9	49,187	戸田建設	80	76	39,140	千代田化工建	46	47	37,506	カゴメ	21	23.1	57,495	熊谷組	83	97	25,608	新興プランテック	14.4	13.5	9,517	アリアケジャパン	6.1	5.6	29,400	北野建設	20	33	8,415	食料品 (4.9%)	71	71	75,331	ニチレイ	71	71	136,552	三井ホーム	16	13	5,954	日本製粉	39	43	32,379	東洋水産	32.6	31.5	136,552	矢作建設	10.7	10.1	9,059	日清製粉G本社	70	71	107,352	日清食品HD	26.5	27.2	165,376	ピーエス三菱	—	20.3	7,064	昭和産業	30	27	13,986	永谷園ホールディングス	8	8	10,080	日本ハウスHLDGS	14.1	27.2	10,390	中部飼料	4.8	8.5	6,069	一正蒲鉾	0.4	—	—	大東建託	23.3	24.4	390,278	フィード・ワン	61.9	54.7	6,235	フジッコ	7	6.9	14,959	新日本建設	4.7	10.7	9,416	日本甜菜糖	49	49	9,408	ロックフィールド	4.2	8.4	11,944	NIPPPO	14	15	28,605	三井製糖	29	28	13,020	日本たばこ産業	375.6	361.7	1,434,502	東亜道路	16	27	6,831	森永製菓	62	61	54,717	わらべや日洋HD	4.4	4.1	8,122	ユーグレナ	21	22.5	32,625

■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 2,980,000 (1,418,700)	株 (—)

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

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

■投資信託財産の構成

2016年9月20日現在

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

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年9月20日現在

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

* 期首における元本額は142,153,807,198円、当期中における追加設定元本額は14,010,676,969円、同解約元本額は12,923,853,400円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、適格機関投資家専用投信1号1,611,697,194円、トピックス・インデックスファンド5,870,349,708円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A 14,459,562,673円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2 123,973,859円、ダイワ国内重視バランスファンド30V A (一般投資家私募) 155,132,020円、ダイワ国内重視バランスファンド50V A (一般投資家私募) 2,622,187,560円、ダイワ国際分散バランスファンド30V A (一般投資家私募) 118,142,999円、ダイワ国際分散バランスファンド50V A (一般投資家私募) 3,671,223,973円、D-I's T O P I X インデックス33,397,291円、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド24,801,250円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 593,766円、i F r e e T O P I X インデックス14,707,636円、i F r e e 8 資産バランス9,416,329円、D Cダイワ日本株式インデックス64,175,618,880円、ダイワ・ライフ・バランス30 2,466,829,698円、ダイワ・ライフ・バランス50 2,424,386,068円、ダイワ・ライフ・バランス70 2,171,081,155円、年金ダイワ日本株式インデックス3,783,254,324円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 26,357,149円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 62,358,348円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 12,485,710円、ダイワ世界分散バランスファンド15V A 448,097円、ダイワ世界分散バランスファンド20V A 440,730円、ダイワ世界分散バランスファンド20V A (国内株式型) 941,908円、ダイワ世界分散バランスファンド25V A 65,202,419円、ダイワ世界分散バランスファンド30V A 369,460,228円、ダイワ世界分散バランスファンド30V A (国内株式型) 200,755,185円、ダイワ世界バランスファンド40V A 1,628,116,331円、ダイワ世界バランスファンド60V A 256,425,062円、ダイワ・バランスファンド35V A 15,311,443,452円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50V A 432,461,659円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75V A 742,797,027円、ダイワ・バランスファンド25V A (適格機関投資家専用) 1,317,289,178円、ダイワ国内バランスファンド25V A (適格機関投資家専用) 203,482,755円、ダイワ国内バランスファンド30V A (適格機関投資家専用) 327,434,084円、ダイワ・ノーロード T O P I X ファンド26,401,434円、ダイワ・インデックスセレクト T O P I X 967,581,041円、ダイワライフスタイル25 225,777,125円、ダイワライフスタイル50 688,315,084円、ダイワライフスタイル75 518,580,161円、D C・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド) 16,119,720,217円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は7,944円です。

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

■損益の状況

当期 自2015年9月25日 至2016年9月20日

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

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

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

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1期

(決算日 2017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1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00~17:00）

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

<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				
1期末(2017年6月15日)	円 12,007	円 0	% 20.1	円 19,831.82	% 18.4	% 98.2	% 1.8	百万円 3,303

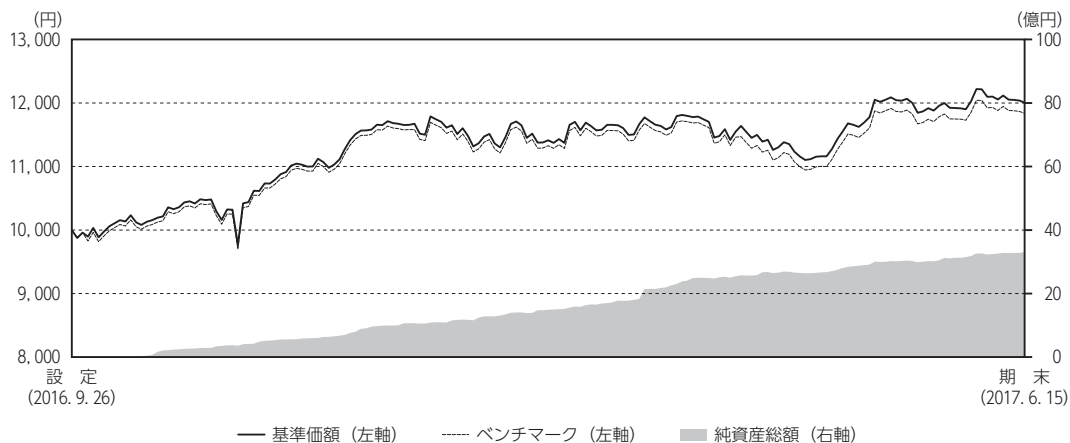
(注1) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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、設定時を10,000として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

設定時：10,000円

期末：12,007円

騰落率：20.1%

■ 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、米国新大統領による政策期待などから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
	円	騰 落 率	(ベンチマーク) 円	騰 落 率		
(設定) 2016年 9月26日	10,000	—	(9/23) 16,754.02	—	—	—
9月末	9,886	△ 1.1	16,449.84	△ 1.8	98.1	1.7
10月末	10,471	4.7	17,425.02	4.0	98.0	2.0
11月末	11,001	10.0	18,308.48	9.3	98.1	1.8
12月末	11,500	15.0	19,114.37	14.1	98.8	1.2
2017年 1月末	11,452	14.5	19,041.34	13.7	98.5	1.5
2月末	11,505	15.1	19,118.99	14.1	98.3	1.6
3月末	11,451	14.5	18,909.26	12.9	98.0	2.0
4月末	11,625	16.3	19,196.74	14.6	97.5	2.5
5月末	11,901	19.0	19,650.57	17.3	97.9	2.1
(期末) 2017年 6月15日	12,007	20.1	19,831.82	18.4	98.2	1.8

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2016. 9. 26 ~ 2017. 6. 15)

国内株式市況

国内株式市況は、設定時より、米国大統領選挙に関する見方が交錯したことなどから、一進一退で推移しました。2016年11月には、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、上昇基調に転じました。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、株価は再び一進一退で推移しました。2017年4月に入ると、東アジアの地政学リスクの高まりが懸念され、株価は下落しました。しかし4月後半からは、地政学リスク悪化の一巡に加えて、フランス大統領選挙で中道派のマクロン氏が極右政党の候補者を抑えて当選したことが好感され、株価は上昇しました。

ポートフォリオについて

(2016. 9. 26 ~ 2017. 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、2017年2月に東芝の売却を行ない、以降、組み入れを見送りました。

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18.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は20.1%となりました。

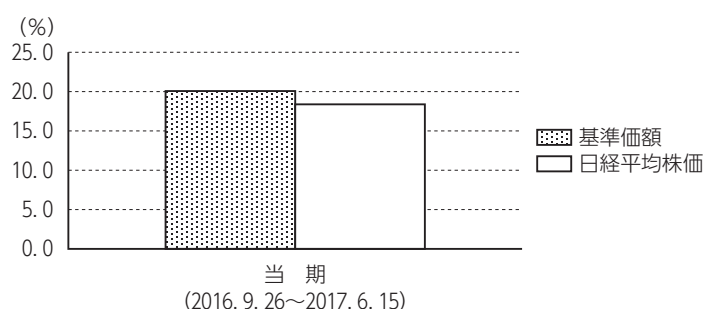
ほぼ100%組み入れているマザーファンドに組入銘柄の配当金が計上されたのに対し、ベンチマークである日経平均株価には配当金の影響が考慮されていないことが、プラスのかい離要因となりました。

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。

- ・トラッキング・エラーは、2016年10月～2017年5月の期間で0.79%と低位で安定しております。
 ※トラッキング・エラーとは、ファンドの基準価額の騰落率からベンチマーク（日経平均株価）の騰落率を差し引いた超過騰落率の振れの度合いを示すもので、この値が低いほど、ファンドのベンチマークに対する連動率が高いと考えることができます。

具体的には毎月の超過騰落率を二乗し、その平均値の平方根を年率換算して算出します。

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	
	2016年9月26日 ～2017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)	2,007

- (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（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。

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2016.9.26~2017.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	27円	0.241%	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11,309円です。
（投信会社）	(17)	(0.148)	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）	(9)	(0.078)	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)	(0.016)	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／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
（先物）	(0)	(0.001)	
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	0.004	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）	(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)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	28	0.247	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年9月26日から2017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	1,395,366 千口	3,137,010 千円	6,654 千口	15,405 千円

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2016年9月26日から2017年6月15日まで)

項 目	当 期	
	ストックインデックス225・マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	56,319,910千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	148,203,684千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.38	

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2016年9月26日から2017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
株式	百万円 4,963	百万円 2,984	% 60.1	百万円 51,356	百万円 18,047	% 35.1
株式先物取引	30,598	—	—	31,022	—	—
コール・ローン	366,400	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合1.0%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2016年9月26日から2017年6月15日まで)

種 類	当 期		
	ストックインデックス225・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
株式	百万円 4	百万円 71	百万円 168

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
百万円 1	百万円 —	百万円 1	百万円 —	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
ストックインデックス225・マザーファンド	1,388,712 千口	3,302,635 千円

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017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	3,302,635 千円	99.8 %
コール・ローン等、その他	5,211	0.2
投資信託財産総額	3,307,847	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6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,307,847,141円
コール・ローン等	5,211,949
ストックインデックス225・マザーファンド (評価額)	3,302,635,192
(B) 負債	4,649,203
未払解約金	2,479,471
未払信託報酬	2,134,597
その他未払費用	35,135
(C) 純資産総額 (A - B)	3,303,197,938
元本	2,751,053,801
次期繰越損益金	552,144,137
(D) 受益権総口数	2,751,053,801口
1万口当り基準価額 (C / D)	12,007円

*設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は2,867,193,216円、同解約元本額は117,139,415円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は12,007円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月26日 至2017年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 969円
受取利息	20
支払利息	△ 989
(B) 有価証券売買損益	174,439,816
売買益	181,031,736
売買損	△ 6,591,920
(C) 信託報酬等	△ 3,927,722
(D) 当期損益金 (A + B + C)	170,511,125
(E) 追加信託差損益金	381,633,012
(配当等相当額)	(△ 429)
(売買損益相当額)	(381,633,441)
(F) 合計 (D + E)	552,144,137
次期繰越損益金 (F)	552,144,137
追加信託差損益金	381,633,012
(配当等相当額)	(△ 429)
(売買損益相当額)	(381,633,441)
分配準備積立金	170,512,094
繰越損益金	△ 969

- (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	170,512,094
(c) 収益調整金	381,633,441
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	552,145,535
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	552,145,535
(h) 受益権総口数	2,751,053,801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（2016年9月20日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017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

(2016年9月26日から2017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
大塚ホールディングス	298	1,539,717	5,166	ファーストリテイリング	102	4,031,401	39,523
楽天	360	472,437	1,312	ソフトバンクグループ	306	2,423,329	7,919
ファーストリテイリング	6	210,502	35,083	ファナック	102	2,139,251	20,973
ソフトバンクグループ	18	143,226	7,957	KDDI	612	1,841,510	3,009
ファナック	6	137,084	22,847	東京エレクトロン	102	1,230,238	12,061
KDDI	36	105,876	2,941	京セラ	204	1,215,881	5,960
京セラ	12	74,004	6,167	ダイキン工業	102	1,101,504	10,799
東京エレクトロン	6	71,678	11,946	信越化学	102	936,900	9,185
ダイキン工業	6	65,856	10,976	日東電工	102	885,801	8,684
信越化学	6	57,394	9,565	テルモ	204	856,841	4,200

(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、2017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（57,587,549千円）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2017年6月15日現在		銘柄	2017年6月15日現在		銘柄	2017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%)			日本製紙	25.8	57,972	ブリヂストン	258	1,216,212
日本水産	258	178,278	北越紀州製紙	258	232,200	ガラス・土石製品 (1.5%)		
マルハニチロ	25.8	81,399	化学 (8.9%)			旭硝子	258	241,230
鉱業 (0.1%)			クラレ	258	521,418	日本板硝子	25.8	21,749
国際石油開発帝石	103.2	107,534	旭化成	258	287,670	日本電気硝子	387	291,024
建設業 (2.9%)			昭和電工	25.8	63,029	住友大阪セメント	258	125,904
コムシスホールディングス	258	606,042	住友化学	258	151,188	太平洋セメント	258	93,138
大成建設	258	264,708	日産化学	258	963,630	東海カーボン	258	162,024
大林組	258	339,012	東ソー	258	273,222	ＴＯＴＯ	129	549,540
清水建設	258	302,376	トクヤマ	258	128,742	日本碍子	258	554,958
長谷工コーポレーション	51.6	77,090	デンカ	258	141,900	鉄鋼 (0.2%)		
鹿島建設	258	237,876	信越化学	258	2,568,648	新日鐵住金	25.8	60,397
大和ハウス	258	982,722	三井化学	258	145,512	神戸製鋼所	25.8	26,445
積水ハウス	258	510,066	三菱ケミカル HLDGS	129	109,985	JFEホールディングス	25.8	45,936
日揮	258	447,630	宇部興産	258	70,176	日新製鋼	25.8	30,856
千代田化工建	258	166,152	日本化薬	258	409,188	大平洋金属	258	72,498
食料品 (5.4%)			花王	258	1,776,846	非鉄金属 (1.3%)		
日清製粉G本社	258	494,328	富士フイルム HLDGS	258	1,031,484	日本軽金属HD	258	67,338
明治ホールディングス	51.6	478,332	資生堂	258	997,944	三井金属	258	105,780
日本ハム	258	937,830	日東電工	258	2,291,814	東邦亜鉛	258	109,392
サッポロホールディングス	51.6	169,764	医薬品 (7.6%)			三菱マテリアル	25.8	79,851
アサヒグループホールディングス	258	1,131,846	協和発酵キリン	258	521,160	住友鉱山	258	343,140
キリンHD	258	634,035	武田薬品	258	1,447,122	DOWAホールディングス	258	208,722
宝ホールディングス	258	312,954	アステラス製薬	1,290	1,762,785	古河機金	258	48,504
キッコーマン	258	946,860	大日本住友製薬	258	437,052	古河電工	25.8	129,516
味の素	258	636,744	塩野義製薬	258	1,565,286	住友電工	258	445,050
ニチレイ	129	436,020	中外製薬	258	1,064,250	フジクラ	258	248,196
日本たばこ産業	258	1,056,768	エーザイ	258	1,570,704	金属製品 (0.4%)		
繊維製品 (0.3%)			第一三共	258	628,617	SUMCO	25.8	44,143
東洋紡	258	52,374	大塚ホールディングス	258	1,249,752	東洋製罐グループHD	258	477,042
ユニチカ	258	21,156	石油・石炭製品 (0.3%)			機械 (5.1%)		
帝人	51.6	107,844	昭和シエル石油	258	273,738	日本製鋼所	51.6	87,565
東レ	258	235,296	JXTGホールディングス	258	125,259	オークマ	258	258,516
パルプ・紙 (0.3%)			ゴム製品 (1.1%)			アマダホールディングス	258	326,886
王子ホールディングス	258	147,318	横浜ゴム	129	277,866	小松製作所	258	692,472

銘柄	2017年6月15日現在		銘柄	2017年6月15日現在		銘柄	2017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	
住友重機械	258	183,180	関西電力	25.8	41,280	松井証券	258	235,812	
日立建機	258	674,154	東京瓦斯	258	156,864	保険業 (1.1%)			
クボタ	258	492,135	大阪瓦斯	258	117,931	SOMPOホールディングス	64.5	278,317	
荏原製作所	51.6	155,316	陸運業 (2.3%)			MS & AD	77.4	302,479	
ダイキン工業	258	2,831,550	東武鉄道	258	157,896	SONY FH	51.6	93,292	
日本精工	258	347,010	東京急行	258	215,688	第一生命HLDGS	25.8	50,052	
NTN	258	126,420	小田急電鉄	129	296,700	東京海上HD	129	625,779	
ジェイテクト	258	410,478	京王電鉄	258	245,100	T&Dホールディングス	51.6	85,836	
日立造船	51.6	27,812	京成電鉄	129	384,420	その他金融業 (0.4%)			
三菱重工業	258	110,449	東日本旅客鉄道	25.8	286,896	クレディセゾン	258	572,760	
IHI	258	98,556	西日本旅客鉄道	25.8	206,993	不動産業 (1.9%)			
電気機器 (18.2%)			東海旅客鉄道	25.8	472,914	東急不動産HD	258	177,504	
日清紡ホールディングス	258	278,382	日本通運	258	179,310	三井不動産	258	693,891	
コニカミノルタ	258	227,556	ヤマトホールディングス	258	587,724	三菱地所	258	553,410	
ミネベアミツミ	258	465,948	海運業 (0.2%)			東京建物	129	199,305	
日立	258	170,280	日本郵船	258	52,632	住友不動産	258	901,194	
三菱電機	258	403,899	商船三井	258	82,560	サービス業 (3.2%)			
富士電機	258	151,188	川崎汽船	258	71,982	ディー・エヌ・エー	77.4	188,623	
安川電機	258	609,396	空運業 (0.1%)			電通	258	1,408,680	
明電舎	258	94,686	ANAホールディングス	258	99,897	楽天	258	349,977	
ジーエス・ユアサコーポ	258	129,000	倉庫・運輸関連業 (0.3%)			東京ドーム	129	133,386	
日本電気	258	73,788	三菱倉庫	258	381,324	セコム	258	2,205,384	
富士通	258	203,304	情報・通信業 (12.4%)				千株	千円	
沖電気	25.8	40,996	ヤフー	103.2	49,020	合計	株数・金額	50,890.5	134,490,260
パナソニック	258	374,616	トレンドマイクロ	258	1,462,860	銘柄数<比率>	224銘柄	<98.2%>	
ソニー	258	1,067,604	スカパーJSATHD	25.8	12,616				
TDK	258	1,875,660	日本電信電話	51.6	273,634				
アルプス電気	258	755,424	KDDI	1,548	4,651,740				
パイオニア	258	51,600	NTTドコモ	25.8	69,840				
横河電機	258	477,042	東宝	25.8	87,462				
アドバンテスト	516	1,037,676	NTTデータ	258	1,571,220				
カシオ	258	431,634	コナミホールディングス	258	1,640,880				
ファナック	258	5,517,330	ソフトバンクグループ	774	6,855,318				
京セラ	516	3,306,012	卸売業 (2.1%)						
太陽誘電	258	423,894	双日	25.8	6,914				
SCREENホールディングス	51.6	411,252	伊藤忠	258	408,285				
キヤノン	387	1,507,365	丸紅	258	178,149				
リコー	258	246,648	豊田通商	258	861,720				
東京エレクトロン	258	4,111,230	三井物産	258	392,805				
輸送用機器 (6.2%)			住友商事	258	365,586				
デンソー	258	1,201,764	三菱商事	258	581,532				
三井造船	258	39,474	小売業 (10.5%)						
川崎重工業	258	81,786	J.フロントリテイリング	129	215,043				
日産自動車	258	278,382	三越伊勢丹HD	258	298,506				
いすゞ自動車	129	172,924	セブン&アイ・HLDGS	258	1,234,788				
トヨタ自動車	258	1,494,852	ユニー・ファミリーマートHD	258	1,707,960				
日野自動車	258	316,824	高島屋	258	295,926				
三菱自動車工業	25.8	18,447	丸井グループ	258	443,244				
マツダ	51.6	77,322	イオン	258	442,728				
本田技研	516	1,577,412	ファーストリテイリング	258	9,468,600				
スズキ	258	1,345,986	銀行業 (1.0%)						
SUBARU	258	953,052	コンコルディア・フィナンシャル	258	139,500				
ヤマハ発動機	258	728,334	新生銀行	258	47,730				
精密機器 (2.9%)			あおぞら銀行	258	109,908				
テルモ	516	2,272,980	三菱UFJフィナンシャルG	258	184,470				
ニコン	258	454,596	りそなホールディングス	25.8	15,139				
オリンパス	258	1,013,940	三井住友トラストHD	25.8	98,452				
シチズン時計	258	193,758	三井住友フィナンシャルG	25.8	108,231				
その他製品 (1.2%)			千葉銀行	258	204,078				
凸版印刷	258	319,662	ふくおかフィナンシャルG	258	138,288				
大日本印刷	258	318,888	静岡銀行	258	245,616				
ヤマハ	258	915,900	みずほフィナンシャルG	258	50,800				
電気・ガス業 (0.3%)			証券・商品先物取引業 (0.4%)						
東京電力HD	25.8	11,764	大和証券G本社	258	168,448				
中部電力	25.8	38,996	野村ホールディングス	258	171,363				

(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	2017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	2,456	—

(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15期 (決算日 2016年9月20日)

(計算期間 2015年9月25日～2016年9月20日)

ストックインデックス225・マザーファンドの第15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

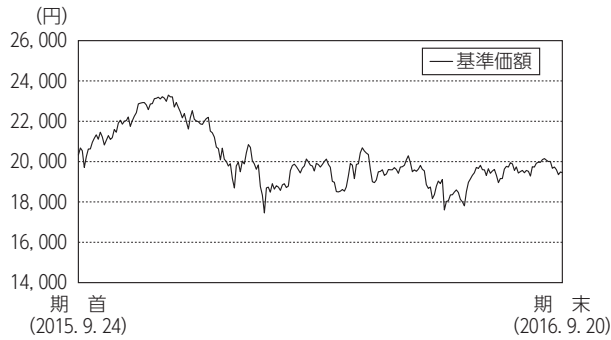
大和投資信託

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



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
	円	%	円	%		
(期首)2015年9月24日	20,324	—	17,571.83	—	98.4	1.6
9月末	20,240	△ 0.4	17,388.15	△ 1.0	97.7	2.3
10月末	22,211	9.3	19,083.10	8.6	98.1	1.9
11月末	22,989	13.1	19,747.47	12.4	98.3	1.7
12月末	22,196	9.2	19,033.71	8.3	98.0	2.0
2016年1月末	20,441	0.6	17,518.30	△ 0.3	98.2	1.8
2月末	18,716	△ 7.9	16,026.76	△ 8.8	98.2	1.8
3月末	19,720	△ 3.0	16,758.67	△ 4.6	97.6	2.4
4月末	19,613	△ 3.5	16,666.05	△ 5.2	98.2	1.8
5月末	20,290	△ 0.2	17,234.98	△ 1.9	98.0	2.0
6月末	18,360	△ 9.7	15,575.92	△ 11.4	98.6	1.4
7月末	19,534	△ 3.9	16,569.27	△ 5.7	98.4	1.6
8月末	19,922	△ 2.0	16,887.40	△ 3.9	98.8	1.2
(期末)2016年9月20日	19,454	△ 4.3	16,492.15	△ 6.1	98.6	1.4

(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：20,324円 期末：19,454円 騰落率：△4.3%

【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、世界経済の先行き懸念や円高進行から日経平均株価が下落したことを受けて、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、世界経済の先行き不透明感や円高の進行などで軟調に始まりましたが、2015年10月に入ると、世界経済に対する過度な不安感が後退したことやECB（欧州中央銀行）が追加金融緩和を示唆したこと、中国が追加金融緩和を実施したことなどで上昇しました。12月以降は、ECBの追加金融緩和策への失望や原油価格の下落、中国・人民元安と中国株安、円高などにより

株価は下落しました。2016年1月末には日銀がマイナス金利を導入し一時的に株価は上昇しましたが、その後は、米国経済および中国経済への懸念や欧州金融機関の信用不安などで下落しました。2月後半からは、米国の製造業関連指標の回復や中国およびECBの金融緩和などにより株価は反発しましたが、3月後半以降は、日米金融政策や米国為替政策への懸念から為替相場が不安定になり、株価も乱高下しました。6月には、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱支持が多数だったことを受けて株価は下落しましたが、7月下旬には、国内の財政・金融政策への期待や円高傾向の一服などから戻り基調となりました。8月以降は売り買いが交錯し、上値の重い展開で期末を迎えました。

◆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、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す。

◆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の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、日経平均株価採用銘柄すべて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△6.1%となりました。

一方、当ファンドの騰落率は△4.3%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。

・資金の流出入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す。

■1万口当りの費用の明細

項目	当	期
売買委託手数料		2円
(株式)	(0)
(先物)	(2)
有価証券取引税		—
その他費用		—
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方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

(2015年9月25日から2016年9月20日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 23,133.6 (△1,508.092)	千円 49,619,436 (—)	千株 10,776.008	千円 22,053,765

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2)先物取引の種類別取引状況

(2015年9月25日から2016年9月20日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 株式先物取引	百万円 43,459	百万円 43,434	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2015年9月25日から2016年9月20日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	当 期		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
ファーストリテイリング	千株 106	千円 3,979,738	円 37,544	ファーストリテイリング	千株 48	千円 1,840,444	円 38,342
ユニー・ファミリーマートHD	309.5	2,428,896	7,847	ソフトバンクグループ	144	922,080	6,403
ファナック	106	1,922,373	18,135	ファナック	48	909,361	18,945
KDDI	636	1,870,986	2,941	KDDI	288	892,842	3,100
ソフトバンクグループ	318	1,760,824	5,537	京セラ	96	516,324	5,378
京セラ	212	1,091,417	5,148	ダイキン工業	48	430,141	8,961
アステラス製薬	530	851,538	1,606	アステラス製薬	240	396,842	1,653
ダイキン工業	106	835,362	7,880	東京エレクトロン	48	396,667	8,263
セコム	106	833,015	7,858	テルモ	96	395,509	4,119
テルモ	212	800,932	3,777	セコム	48	389,593	8,116

(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			
	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	
水産・農林業 (0.2%)	千株	千株	千円	北越紀州製紙	千株	千株	千円	旭硝子	千株	千株	千円	旭硝子	千株	千円
日本水産	294	352	155,936	化学 (8.3%)	294	352	219,296	日本板硝子	294	352	28,864	日本板硝子	294	352
マルハニチロ	29.4	35.2	87,225	クラレ	294	352	500,896	日本電気硝子	441	528	273,504	住友大阪セメント	294	352
鉱業 (0.1%)				旭化成	294	352	281,388	住友太平洋セメント	294	352	162,624	太平洋セメント	294	352
国際石油開発帝石	117.6	140.8	116,399	昭和電工	294	35.2	44,105	東海カーボン	294	352	97,856	TOTO	294	176
建設業 (2.8%)				住友化学	294	352	161,216	日本碍子	294	352	743,776	鉄鋼 (0.2%)		
コムシスホールディングス	294	352	647,328	日産化学	294	352	1,089,440	新日鐵住金	294	35.2	69,168	新日鐵住金	294	35.2
大成建設	294	352	267,520	日本曹達	294	352	148,544	神戸製鋼所	294	352	31,680	神戸製鋼所	294	352
大林組	294	352	347,072	東ソー	294	352	216,480	JFEホールディングス	29.4	35.2	50,793	JFEホールディングス	29.4	35.2
清水建設	294	352	313,280	トクヤマ	294	352	121,792	日新製鋼	29.4	35.2	46,076	日新製鋼	29.4	35.2
長谷工コーポレーション	—	70.4	65,964	デンカ	294	352	158,752	大平洋金属	294	352	100,320	大平洋金属	294	352
鹿島建設	294	352	245,696	信越化学	294	352	2,474,560	非鉄金属 (1.3%)				日本軽金属HD	294	352
大和ハウス	294	352	936,144	三井化学	294	352	164,032	三井金属	294	352	72,864	三井金属	294	352
積水ハウス	294	352	588,720	三菱ケミカルHLDGS	147	176	106,761	東邦亜鉛	294	352	110,176	東邦亜鉛	294	352
日揮	294	352	594,528	宇部興産	294	352	67,232	三菱マテリアル	294	352	99,968	三菱マテリアル	294	352
千代田化工建	294	352	280,896	日本化薬	294	352	373,824	住友鉱山	294	352	457,600	住友鉱山	294	352
食料品 (5.4%)				花王	294	352	1,992,320	DOWAホールディングス	294	352	241,824	DOWAホールディングス	294	352
日清製粉G本社	294	352	532,224	富士フイルムHLDGS	294	352	1,341,824	古河機金	294	352	55,264	古河機金	294	352
明治ホールディングス	29.4	70.4	673,024	資生堂	294	352	949,520	古河電工	294	352	90,816	古河電工	294	352
日本ハム	294	352	853,600	日東電工	294	352	2,330,944	住友電工	294	352	506,704	住友電工	294	352
サッポロホールディングス	294	70.4	193,036	医薬品 (7.7%)				フジクラ	294	352	196,416	フジクラ	294	352
アサヒグループホールディング	294	352	1,252,064	協和発酵キリン	294	352	555,104	金属製品 (0.4%)				SUMCO	29.4	35.2
キリンHD	294	352	573,584	武田薬品	294	352	1,634,688	SUMCO	29.4	35.2	28,969	SUMCO	29.4	35.2
宝ホールディングス	294	352	328,064	アステラス製薬	1,470	1,760	2,762,320	東洋製罐グループHD	294	352	647,680	東洋製罐グループHD	294	352
キッコーマン	294	352	1,126,400	大日本住友製薬	294	352	630,432	機械 (5.2%)				日本製鋼所	294	352
味の素	294	352	782,848	塩野義製薬	294	352	1,763,520	オークマ	294	352	266,112	日本製鋼所	294	352
ニチレイ	294	352	373,472	中外製薬	294	352	1,226,720	アマダホールディングス	294	352	375,936	アマダホールディングス	294	352
日本たばこ産業	294	352	1,396,032	エーザイ	294	352	2,244,704	小松製作所	294	352	805,552	小松製作所	294	352
繊維製品 (0.4%)				第一三共	294	352	850,608	住友重機械	294	352	177,408	住友重機械	294	352
東洋紡	294	352	57,728	石油・石炭製品 (0.3%)				日立建機	294	352	696,608	日立建機	294	352
ユニチカ	294	352	19,712	昭和シエル石油	294	352	312,224	クボタ	294	352	516,032	日立建機	294	352
日清紡ホールディングス	294	—	—	JXホールディングス	294	352	138,300	荏原製作所	294	352	195,008	日立建機	294	352
帝人	294	352	138,688	ゴム製品 (1.0%)				横濱ゴム	147	176	287,408	日立建機	294	352
東レ	294	352	338,870	ブリヂストン	294	352	1,277,056	ガラス・土石製品 (1.5%)				日立建機	294	352
パルプ・紙 (0.3%)				日東紡績	294	—	—	日東紡績	294	—	—	日立建機	294	352
王子ホールディングス	294	352	142,208									日立建機	294	352
日本製紙	29.4	35.2	65,296									日立建機	294	352

ストックインデックス225・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	株数	千円		株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千円	
ダイキン工業	294	352	3,297	536	その他製品 (1.2%)					ファーストリテイリング	294	352	11,443	520	
日本精工	294	352	368	896	凸版印刷	294	352	327	008	銀行業 (1.0%)					
NTN	294	352	125	664	大日本印刷	294	352	359	744	コンコルディア・フィナンシャル	—	352	170	966	
ジェイテクト	294	352	521	312	ヤマハ	294	352	1,121	120	新生銀行	294	352	53	856	
日立造船	58.8	70.4	36	185	電気・ガス業 (0.3%)					あおぞら銀行	294	352	124	960	
三菱重工業	294	352	152	908	東京電力HD	29.4	35.2	14	748	三菱UFJフィナンシャルG	294	352	181	420	
IHI	294	352	99	616	中部電力	29.4	35.2	52	923	りそなホールディングス	29.4	35.2	15	276	
電気機器 (16.9%)					関西電力	29.4	35.2	32	426	三井住友トラストHD	294	352	120	560	
日清紡ホールディングス	—	352	359	744	東京瓦斯	294	352	165	756	三井住友フィナンシャルG	29.4	35.2	120	982	
コニカミノルタ	294	352	304	832	大阪瓦斯	294	352	150	409	千葉銀行	294	352	207	328	
ミネベア	294	352	333	344	陸運業 (2.5%)					横浜銀行	294	—	—	—	
日立	294	352	166	636	東武鉄道	294	352	180	576	ふくおかフィナンシャルG	294	352	146	784	
東芝	294	352	111	232	京急	294	352	274	912	静岡銀行	294	352	291	104	
三菱電機	294	352	441	232	小田急電鉄	294	352	397	408	みずほフィナンシャルG	294	352	61	318	
富士電機	294	352	160	512	京王電鉄	294	352	312	224	証券・商品先物取引業 (0.5%)					
安川電機	294	352	525	536	京成電鉄	294	352	450	912	大和証券G本社	294	352	202	153	
明電舎	294	352	115	808	東日本旅客鉄道	29.4	35.2	315	884	野村ホールディングス	294	352	162	342	
ジーエス・ユアサコーポ	294	352	145	728	西日本旅客鉄道	29.4	35.2	219	225	松井証券	294	352	322	080	
日本電気	294	352	90	464	東海旅客鉄道	29.4	35.2	614	768	保険業 (1.0%)					
富士通	294	352	188	742	日本通運	294	352	177	408	損保ジャパン興亜HD	73.5	88	278	080	
沖電気	294	352	48	576	ヤマトホールディングス	294	352	856	240	MS&AD	88.2	105.6	307	243	
パナソニック	294	352	358	336	海運業 (0.2%)					SONY F H	58.8	70.4	104	403	
シャープ	294	—	—	—	日本郵船	294	352	65	472	第一生命	29.4	35.2	50	635	
ソニー	294	352	1,168	640	商船三井	294	352	82	016	東京海上HD	147	176	685	872	
TDK	294	352	2,537	920	川崎汽船	294	352	90	112	T&Dホールディングス	58.8	70.4	86	028	
ミツミ電機	294	352	203	104	空運業 (0.1%)					その他金融業 (0.4%)					
アルプス電気	294	352	867	680	ANAホールディングス	294	352	99	968	クレディセゾン	294	352	608	960	
パイオニア	294	352	78	144	倉庫・運輸関連業 (0.4%)					不動産業 (1.8%)					
横河電機	294	352	465	696	三菱倉庫	294	352	536	096	東急不動産HD	294	352	190	784	
アドバンテス	588	704	946	880	情報・通信業 (12.2%)					三井不動産	294	352	730	928	
カシオ	294	352	495	264	ヤフー	117.6	140.8	57	587	三菱地所	294	352	659	296	
ファナック	294	352	5,954	080	トレンドマイクロ	294	352	1,244	320	平和不動産	58.8	—	—	—	
京セラ	588	704	3,510	144	スカパー JSA THD	29.4	35.2	16	684	東京建物	147	176	213	664	
太陽誘電	294	352	362	560	日本電信電話	58.8	70.4	324	825	住友不動産	294	352	917	136	
SCREENホールディングス	294	352	441	408	KDDI	1,764	2,112	6,477	504	サービス業 (3.4%)					
キャノン	441	528	1,532	256	NTTドコモ	29.4	35.2	90	076	ディー・エヌ・エー	—	105.6	403	392	
リコー	294	352	325	248	東宝	29.4	35.2	116	864	電通	294	352	1,869	120	
東京エレクトロン	294	352	3,229	248	NTTデータ	294	352	1,833	920	東京ドーム	294	176	172	480	
輸送用機器 (6.7%)					コナミホールディングス	294	352	1,346	400	セコム	294	352	2,673	792	
デンソー	294	352	1,456	224	ソフトバンクグループ	882	1,056	6,839	712						
三井造船	294	352	49	632	卸売業 (2.0%)					合計	株数、金額	62,489.7	千株	千株	千円
川崎重工業	294	352	109	120	双日	29.4	35.2	8	905	銘柄数<比率>	225銘柄	225銘柄	<98.6%>		
日産自動車	294	352	355	168	伊藤忠	294	352	435	776	(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。				
いすゞ自動車	147	176	215	424	丸紅	294	352	179	168	(注2)	合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。				
トヨタ自動車	294	352	2,095	104	豊田通商	294	352	835	296	(注3)	評価額の単位未満は切捨て。				
日野自動車	294	352	383	680	三井物産	294	352	472	912						
三菱自動車工業	29.4	35.2	16	192	住友商事	294	352	392	128	(2)先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)					
マツダ	58.8	70.4	111	302	三菱商事	294	352	747	648	銘柄別	当期末				
本田技研	588	704	2,084	544	小売業 (11.5%)					買建額	売建額				
スズキ	294	352	1,180	960	J.フロントリテイリング	147	176	224	576	国内	百万円	百万円			
富士重工業	294	352	1,342	880	三越伊勢丹HD	294	352	362	560	日経平均	2,170	—			
ヤマハ発動機	—	352	691	328	セブン&アイ・HLDGS	294	352	1,600	192	(注)	単位未満は切捨て。				
精密機器 (3.1%)					ユニー・ファミリーマートHD	—	352	2,386	560						
テルモ	588	704	2,759	680	高島屋	294	352	288	288						
ニコン	294	352	525	888	丸井グループ	294	352	496	672						
オリンパス	294	352	1,265	440	イオン	294	352	524	480						
シチズンホールディングス	294	352	188	672	ユニーグループ・HD	294	—	—	—						

■投資信託財産の構成

2016年9月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	150,982,568	97.6%
コール・ローン等、その他	3,715,707	2.4%
投資信託財産総額	154,698,275	100.0%

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年9月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	155,558,837,911円
コール・ローン等	1,833,918,286
株式(評価額)	150,982,568,000
未収入金	1,706,470,625
未収配当金	120,841,000
差入委託証拠金	915,040,000
(B) 負債	2,407,962,940
未払金	54,677,940
未払解約金	1,486,985,000
差入委託証拠金代用有価証券	866,300,000
(C) 純資産総額 (A - B)	153,150,874,971
元本	78,725,801,897
次期繰越損益金	74,425,073,074
(D) 受益権総口数	78,725,801,897口
1万口当り基準価額 (C / D)	19,454円

* 期首における元本額は65,793,251,657円、当期中における追加設定元本額は27,704,388,858円、同解約元本額は14,771,838,618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 47,890,676,041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225V A1,255,730,658円、大和 ストック インデックス225ファンド16,540,987,869円、D-I's 日経225インデックス109,267,543円、i F r e e 日経225インデックス7,865,503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) 5,598,873,889円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド-シフト11Ver6-121,798,935円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド-シフト11Ver7-161,450,731円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド-シフト12Ver2-221,928,436円、ダイワ・ノーロード 日経225ファンド217,691,365円、ダイワ・インデックスセレクト 日経225 6,599,530,927円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,454円です。

■損益の状況

当期 自2015年9月25日 至2016年9月20日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,886,934,761円
受取配当金	2,795,832,536
受取利息	745,461
その他収益金	90,906,449
支払利息	△ 549,685
(B) 有価証券売買損益	△ 8,179,590,699
売買益	9,210,763,785
売買損	△ 17,390,354,484
(C) 先物取引等損益	16,773,226
取引益	917,419,699
取引損	△ 900,646,473
(D) その他費用	△ 32,022
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 5,275,914,734
(F) 前期繰越損益金	67,926,219,578
(G) 解約差損益金	△ 15,963,007,117
(H) 追加信託差損益金	27,737,775,347
(I) 合計 (E + F + G + H)	74,425,073,074
次期繰越損益金 (I)	74,425,073,074

(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	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1期

(決算日 2017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1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

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

<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	(ベンチマーク) 11,071	% 10.7	% 93.4	% 3.8	% 0.0	% 2.4	百万円 16,740

(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。

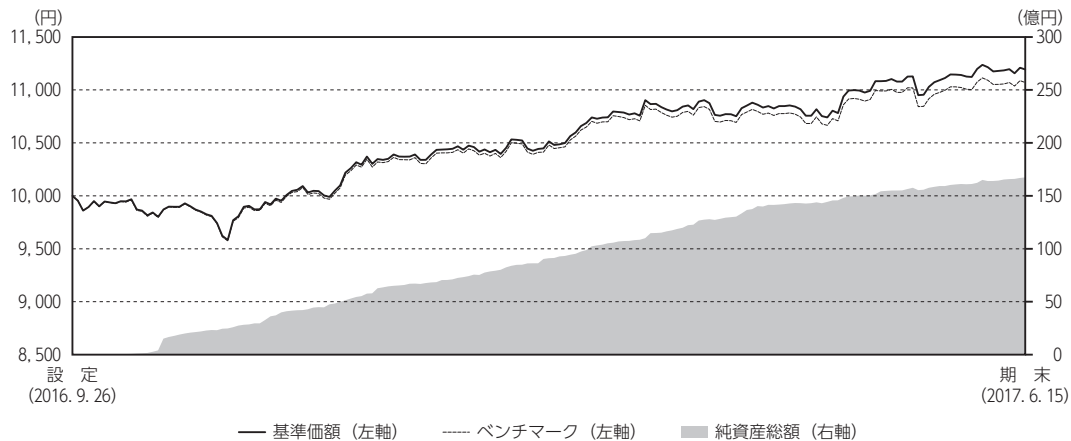
(注3) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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、設定時を10,000として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

設定時：10,000円

期末：11,194円

騰落率：11.9%

■ 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、米国新大統領による政策期待やフランス大統領選挙の結果を好感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。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				
(設定) 2016年 9月26日	10,000	—	(9/23) 10,000	—	—	—	—	—
9月末	9,901	△ 1.0	9,897	△ 1.0	91.9	3.6	—	2.7
10月末	9,825	△ 1.8	9,818	△ 1.8	92.7	7.5	—	2.5
11月末	10,047	0.5	10,027	0.3	93.9	10.3	—	2.3
12月末	10,340	3.4	10,302	3.0	92.0	7.1	—	2.4
2017年 1月末	10,447	4.5	10,413	4.1	91.0	4.7	—	2.3
2月末	10,779	7.8	10,728	7.3	91.7	5.5	—	2.4
3月末	10,880	8.8	10,816	8.2	93.2	6.1	—	2.4
4月末	10,994	9.9	10,912	9.1	92.0	5.8	—	2.4
5月末	11,126	11.3	11,007	10.1	93.2	4.6	—	2.4
(期末) 2017年 6月15日	11,194	11.9	11,071	10.7	93.4	3.8	0.0	2.4

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2016. 9. 26 ~ 2017. 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、設定時より、中国の貿易統計が予想を下回ったことや、米国大統領選挙を控えてリスク回避姿勢が広がったことなどを背景に、軟調な推移となりました。2016年11月に入ると、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことによる新政権の政策への期待から、市況は米国市場を中心に上昇に転じました。2017年1月以降は、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、市況の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などを受けて上昇し、期を通じては上昇して期末を迎えました。

ポートフォリオについて

(2016. 9. 26 ~ 2017. 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は期を通じておおむね100%程度を維持しました。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

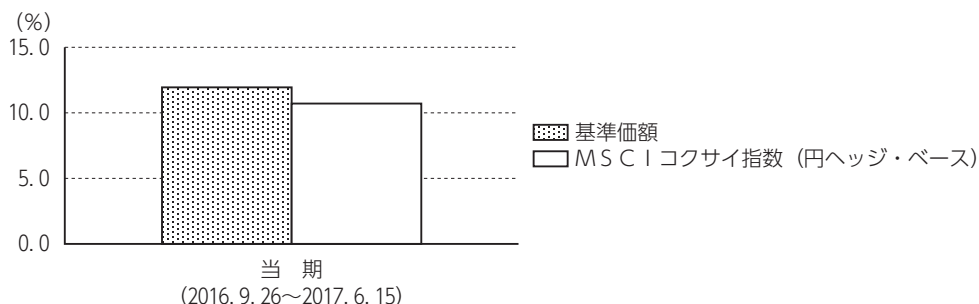
ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式（リート、株式先物を含む。）のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで、基準価額とベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース））との連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

当期のベンチマーク (MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)) の騰落率は10.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は11.9%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、信託報酬・売買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	
	2016年9月26日 ~2017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)	1,194	

- (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 (2016.9.26~2017.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	33円	0.315%	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10,516円です。
(投信会社)	(23)	(0.222)	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)	(8)	(0.078)	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)	(0.016)	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	4	0.033	売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(3)	(0.031)	
(先物)	(0)	(0.002)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
有価証券取引税	5	0.050	有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権総口数 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)	(5)	(0.049)	
(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	12	0.114	その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権総口数
(保管費用)	(11)	(0.108)	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)	(0.002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	54	0.513	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年9月26日から2017年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口数	金額	口数	金額
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	9,909,157 千口	15,672,999 千円	74,914 千口	126,200 千円

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2016年9月26日から2017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	14,261,121千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,796,389千円	
(c) 売買高比率 (a)/(b)	1.11	

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社(自社)による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
1 百万円	— 百万円	1 百万円	— 百万円	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	当 期 末	
	口数	評価額
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 千口	16,736,897 千円

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国株式インデックス 為替ヘッジ型マザーファンド	16,736,897 千円	99.7 %
コール・ローン等、その他	51,734	0.3
投資信託財産総額	16,788,632	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=109.72円、1カナダ・ドル=82.89円、1オーストラリア・ドル=83.28円、1香港ドル=14.07円、1シンガポール・ドル=79.70円、1ニュージーランド・ドル=79.51円、1イギリス・ポンド=139.91円、1イスラエル・シェケル=31.15円、1スイス・フラン=112.97円、1デンマーク・クローネ=16.56円、1ノルウェー・クローネ=13.03円、1スウェーデン・クローナ=12.61円、1ユーロ=123.11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(21,309,536千円)の投資信託財産総額(22,048,912千円)に対する比率は、96.6%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	1,105,061,279
(c) 収益調整金	681,096,422
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,786,157,701
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,786,157,701
(h) 受益権総口数	14,953,852,748口

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	16,788,632,848円
コール・ローン等	51,734,986
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)	16,736,897,862
(B) 負債	48,631,663
未払解約金	33,939,274
未払信託報酬	14,509,476
その他未払費用	182,913
(C) 純資産総額 (A - B)	16,740,001,185
元本	14,953,852,748
次期繰越損益金	1,786,148,437
(D) 受益権総口数	14,953,852,748口
1万口当り基準価額 (C/D)	11,194円

- *設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は15,911,823,542円、同解約元本額は958,970,794円です。
 *当期末の計算口数当りの純資産額は11,194円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月26日 至2017年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6,648円
受取利息	245
支払利息	△ 6,893
(B) 有価証券売買損益	1,133,491,476
売買益	1,190,129,335
売買損	△ 56,637,859
(C) 信託報酬等	△ 28,430,197
(D) 当期損益金 (A + B + C)	1,105,054,631
(E) 追加信託差損益金	681,093,806
(配当等相当額)	(△ 2,616)
(売買損益相当額)	(681,096,422)
(F) 合計 (D + E)	1,786,148,437
次期繰越損益金 (F)	1,786,148,437
追加信託差損益金	681,093,806
(配当等相当額)	(△ 2,616)
(売買損益相当額)	(681,096,422)
分配準備積立金	1,105,061,279
繰越損益金	△ 6,648

- (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。

<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（2017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（2017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

(2016年9月26日から2017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)	20.75	296,506	14,289	YAHOO! INC (アメリカ)	4.85	27,665	5,704
MICROSOFT CORP (アメリカ)	28.95	203,894	7,042	SYNGENTA AG-REG (スイス)	0.535	26,717	49,938
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	16.45	155,048	9,425	ENBRIDGE INC (カナダ)	2.902	13,670	4,710
AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.63	152,309	93,441	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD (イスラエル)	2	9,409	4,704
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	10.65	141,251	13,263	NESTLE SA-REG (スイス)	0.7	5,464	7,806
FACEBOOK INC-A (アメリカ)	9.35	138,591	14,822	DUFREY AG-REG (スイス)	0.331	5,015	15,153
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	14.1	129,786	9,204	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD (カナダ)	0.1	4,956	49,567
GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)	35.45	117,844	3,324	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN (スイス)	0.17	4,398	25,873
WELLS FARGO & CO (アメリカ)	19.15	113,592	5,931	APPLE INC (アメリカ)	0.25	4,189	16,759
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	1.24	113,589	91,604	ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC (アメリカ)	0.3	4,052	13,507

(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、2017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（12,815,862千円）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	株数	2017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	7.5	56	6,184	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	6	80	8,813	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3	45	4,977	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	42	122	13,469	金融
ABBOTT LABORATORIES	94.7	451	49,500	ヘルスケア
ARCONIC INC	24	64	7,083	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	8	66	7,282	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	24	156	17,179	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	16	121	13,331	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	19.5	167	18,342	情報技術
QORVO INC	7	50	5,539	情報技術
AFLAC INC	21.5	167	18,423	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	8	72	7,941	一般消費財・サービス
ADOBE SYSTEMS INC	27.5	380	41,714	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11	30	3,303	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	5.5	29	3,203	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	19	33	3,700	金融
GARMIN LTD	7.5	38	4,256	一般消費財・サービス
AETNA INC	18.94	284	31,198	ヘルスケア
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	12	174	19,165	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	41	550	60,388	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7	41	4,549	情報技術
WR BERKLEY CORP	6	41	4,570	金融
AUTOZONE INC	1.4	85	9,345	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	11.99	90	9,902	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56	171	18,844	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	5	44	4,830	公益事業
CELANESE CORP-SERIES A	9	81	8,891	素材
DR HORTON INC	23.5	80	8,862	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4.5	15	1,706	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	11.5	73	8,041	ヘルスケア
AUTODESK INC	10	106	11,652	情報技術
MOODY'S CORP	10	120	13,167	金融
DEVON ENERGY CORP	25	80	8,829	エネルギー
ALBEMARLE CORP	6	65	7,193	素材
ATMOS ENERGY CORP	6	51	5,601	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	13	54	5,929	公益事業
CITIGROUP INC	154.3	998	109,569	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	25	253	27,772	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	28.5	205	22,502	公益事業
ALLEGHANY CORP	0.8	47	5,258	金融
DOMINO'S PIZZA INC	3	63	6,930	一般消費財・サービス

銘柄	2017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	
HESS CORP	13.5	61	6,708	エネルギー
DAVITA INC	10	65	7,238	ヘルスケア
DANAHER CORP	34.5	291	31,970	ヘルスケア
FORTIVE CORP	15	94	10,360	資本財・サービス
AVNET INC	4	15	1,683	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	32.25	208	22,883	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	12	27	2,988	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17.01	35	3,936	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	31.5	132	14,533	生活必需品
BUNGE LTD	9.5	73	8,117	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	20.5	161	17,703	情報技術
APPLE INC	294.5	4,274	469,048	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	22	133	14,635	金融
BOEING CO/THE	32	615	67,545	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9.5	69	7,614	金融
BECTON DICKINSON AND CO	13.23	254	27,946	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	15	34	3,808	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	8.5	46	5,142	情報技術
CDK GLOBAL INC	6	36	4,038	情報技術
NISOURCE INC	20	51	5,687	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6.5	44	4,838	資本財・サービス
CR BARD INC	4	125	13,808	ヘルスケア
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	60.5	301	33,037	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	227.44	1,061	116,513	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	69.5	1,191	130,739	金融
ANSYS INC	4.5	55	6,060	情報技術
H&R BLOCK INC	16	46	5,113	一般消費財・サービス
BB&T CORP	48	213	23,451	金融
BAKER HUGHES INC	23.31	130	14,350	エネルギー
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	96	523	57,426	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	200	1,741	191,110	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	15.5	113	12,455	金融
CIGNA CORP	15	252	27,667	ヘルスケア
LKQ CORP	20.5	66	7,312	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2	28	3,086	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9	44	4,872	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	17	58	6,405	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9.5	121	13,324	金融
DOLLAR GENERAL CORP	15	113	12,452	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	9	91	10,088	情報技術
CATERPILLAR INC	34	356	39,061	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	17	81	8,904	公益事業
MOSAIC CO/THE	15	34	3,742	素材
DELTA AIR LINES INC	10	51	5,695	資本財・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	10	89	9,872	生活必需品
CORNING INC	50	146	16,046	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	283	894	98,120	情報技術
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	49.5	409	44,980	素材
MORGAN STANLEY	79.5	357	39,173	金融
WABCO HOLDINGS INC	3.2	38	4,269	資本財・サービス
DOW CHEMICAL CO/THE	67.5	435	47,791	素材
MSCI INC	4.5	47	5,203	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	2.2	41	4,499	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	4	53	5,846	資本財・サービス
COTY INC-CL A	24.17	46	5,094	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10	38	4,220	情報技術
BROADCOM LTD	22.84	549	60,279	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	3	39	4,284	ヘルスケア
DICK'S SPORTING GOODS INC	2	8	891	一般消費財・サービス
ACUITY BRANDS INC	2	36	3,963	資本財・サービス
ARAMARK	17	68	7,539	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14	46	5,122	素材
DTE ENERGY COMPANY	10.5	116	12,729	公益事業
CENTENE CORP	9	70	7,737	ヘルスケア
CBOE HOLDINGS INC	6	54	5,924	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	30.5	111	12,241	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7.5	43	4,770	金融
GARTNER INC	5	60	6,677	情報技術
SPLUNK INC	6.5	37	4,107	情報技術
AGCO CORP	5	33	3,686	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC	36	287	31,595	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	22.5	114	12,528	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	8	45	4,990	資本財・サービス
DEERE & CO	16	202	22,195	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	8.5	76	8,430	情報技術
TIME WARNER INC	42.16	417	45,860	一般消費財・サービス
VMWARE INC-CLASS A	5	43	4,824	情報技術
NASDAQ INC	5	35	3,897	金融
VAIL RESORTS INC	2.4	49	5,379	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	8.5	50	5,513	金融
TARGA RESOURCES CORP	11	47	5,251	エネルギー

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	2017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		
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2.5	31	3,505	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4.5	45	4,994	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	18.5	154	16,967	公益事業
MEDNAX INC	3	17	1,873	ヘルスケア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	5	50	5,537	一般消費財・サービス
TELEFLEX INC	2	40	4,420	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5	44	4,930	資本財・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6.5	38	4,204	ヘルスケア
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	3	23	2,551	資本財・サービス
IDEX CORP	4.5	50	5,528	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	48.5	368	40,378	生活必需品
AMETEK INC	14.75	90	9,959	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	14	74	8,168	生活必需品
LYONDELLBASELL INDU-CL A	17.5	141	15,539	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	25	454	49,832	生活必需品
SCANA CORP	7	48	5,335	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2.5	40	4,477	金融
WR GRACE & CO	5.5	39	4,283	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1.4	64	7,061	一般消費財・サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP	14	36	3,961	金融
UGI CORP	10	51	5,595	公益事業
CUMMINS INC	9	143	15,749	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	39.5	230	25,331	情報技術
SABRE CORP	16	36	4,007	情報技術
CDW CORP/DE	8	49	5,412	情報技術
SIGNATURE BANK	3.5	52	5,805	金融
COSTAR GROUP INC	1.5	37	4,164	情報技術
SVB FINANCIAL GROUP	3	54	6,009	金融
AMERCO	0.7	24	2,693	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	2.8	74	8,141	情報技術
HANESBRANDS INC	17	39	4,280	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4.5	46	5,129	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10.83	71	7,872	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	10.5	39	4,284	情報技術
DEXCOM INC	4	29	3,277	ヘルスケア
DIAMONDBACK ENERGY INC	6	53	5,885	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	4	25	2,806	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	5	72	7,916	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	3.5	94	10,391	資本財・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	18.5	71	7,847	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	109.96	208	22,874	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	17.5	149	16,388	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	29.5	68	7,476	エネルギー
T-MOBILE US INC	15.5	98	10,760	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	7	32	3,514	情報技術
COCA-COLA CO/THE	232	1,050	115,311	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	7.5	42	4,635	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	6	29	3,198	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	22	97	10,669	金融
CSX CORP	53	281	30,925	資本財・サービス
FLUOR CORP	7	32	3,545	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	5.5	77	8,515	ヘルスケア
EXPEDIA INC	6.5	95	10,497	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	5.5	61	6,712	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	22.9	2,236	245,346	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	16	44	4,896	エネルギー
FLOWSERVE CORP	9	42	4,687	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	13	149	16,404	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	231.26	1,897	208,243	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	8	28	3,159	情報技術
AES CORP	40	47	5,227	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	4	67	7,389	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	2	50	5,538	金融
EOG RESOURCES INC	33.5	297	32,687	エネルギー
EQT CORP	10	57	6,311	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7	34	3,782	情報技術
AMERISOURCEBERGEN CORP	10	93	10,302	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	19.5	115	12,704	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	216.5	242	26,652	一般消費財・サービス
TESARO INC	2	29	3,200	ヘルスケア
MACY'S INC	12	27	2,996	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	11	28	3,170	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	12.16	35	3,881	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	12.5	31	3,486	一般消費財・サービス
MOBILEYE NV	11	68	7,563	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	8.5	39	4,358	資本財・サービス
FORTINET INC	10.5	39	4,360	情報技術
MARKEL CORP	0.8	79	8,707	金融
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	8	19	2,179	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	26.5	374	41,040	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	74.5	90	9,882	素材

銘柄	2017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		
US BANCORP	96	507	55,657	金融
UNITED RENTALS INC	4	41	4,599	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	3	38	4,271	情報技術
FASTENAL CO	14.5	62	6,871	資本財・サービス
FISERV INC	12.5	155	17,091	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	492.5	1,412	155,032	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	7.5	39	4,293	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	11.5	40	4,401	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	73	252	27,721	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	7	26	2,962	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	14.5	291	32,022	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	19.8	448	49,208	金融
ALPHABET INC-CL A	16.6	1,606	176,294	情報技術
ALPHABET INC-CL C	17.41	1,655	181,616	情報技術
GENERAL MILLS INC	32.5	190	20,949	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	21.17	62	6,873	公益事業
GENUINE PARTS CO	8	75	8,273	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	20.05	94	10,381	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	45.5	116	12,770	金融
HARRIS CORP	7.5	82	9,000	情報技術
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9.5	46	5,148	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	51.5	230	25,331	エネルギー
HOME DEPOT INC	68	1,065	116,958	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	2.5	25	2,806	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	55.5	74	8,165	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2	39	4,317	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	7	80	8,785	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	8	42	4,681	一般消費財・サービス
HUMANA INC	8.5	196	21,609	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	10	109	11,989	情報技術
HELMERICH & PAYNE	6	32	3,543	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	4	73	8,076	ヘルスケア
HP INC	91.5	159	17,468	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	86	143	15,795	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	11	43	4,779	一般消費財・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	11	27	3,045	エネルギー
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2	7	872	一般消費財・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8	75	8,272	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	33.5	306	33,617	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	51.5	792	86,911	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	23.5	131	14,410	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	9	58	6,451	資本財・サービス
ZOETIS INC	26.5	164	18,093	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	13.65	121	13,282	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	10	46	5,151	エネルギー
ALLEGION PLC	5.5	43	4,812	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	6.5	34	3,764	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	35.86	101	11,119	一般消費財・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	10	99	10,878	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	18.5	53	5,827	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	6	76	8,392	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	151.5	2,011	220,697	ヘルスケア
ABBVIE INC	90.16	635	69,760	ヘルスケア
HOLOGIC INC	18	80	8,830	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	19	247	27,177	生活必需品
KROGER CO	56	169	18,605	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	8	78	8,650	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	14.2	398	43,671	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5.3	77	8,522	情報技術
L BRANDS INC	13.5	71	7,826	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	50	402	44,195	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	55	448	49,242	ヘルスケア
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	18.5	118	13,029	電気通信サービス
LAM RESEARCH CORP	8.5	129	14,245	情報技術
RANGE RESOURCES CORP	10	23	2,543	エネルギー
JONES LANG LASALLE INC	3	36	3,957	不動産
LOEWS CORP	18	85	9,412	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	13	88	9,734	金融
MCDONALD'S CORP	46	693	76,050	一般消費財・サービス
3M CO	33.5	703	77,191	資本財・サービス
FACEBOOK INC-A	131.5	1,975	216,783	情報技術
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	12.17	75	8,301	情報技術
MANPOWERGROUP INC	3.5	37	4,059	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	15	221	24,260	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3.5	80	8,867	素材
CONCHO RESOURCES INC	7.5	91	10,002	エネルギー
ENVISION HEALTHCARE CORP	5.33	30	3,376	ヘルスケア
FIRST DATA CORP- CLASS A	18.5	33	3,676	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	8	26	2,868	電気通信サービス
PHILLIPS 66	25.97	204	22,447	エネルギー
MURPHY OIL CORP	12.6	31	3,440	エネルギー

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	2017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	
TECHNIPFMC PLC	29	82	9,030	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28	90	9,938	一般消費財・サービス
MATTEL INC	14	31	3,402	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	16.38	122	13,441	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7	73	8,095	生活必需品
MYLAN NV	26.5	100	11,013	ヘルスケア
METLIFE INC	54	287	31,585	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	22	38	4,233	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	2.5	37	4,143	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	5	24	2,704	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7.85	66	7,309	情報技術
MONSANTO CO	25.5	300	33,000	素材
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1.5	87	9,574	ヘルスケア
ROCKWELL AUTOMATION INC	7.5	119	13,154	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	153.87	975	106,985	ヘルスケア
MASCO CORP	15	57	6,323	資本財・サービス
M & T BANK CORP	8.32	135	14,838	金融
MARSH & MCLENNAN COS	27.5	218	24,011	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	16.95	176	19,324	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	8	78	8,652	情報技術
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11	38	4,171	一般消費財・サービス
VANTIV INC - CL A	8	49	5,459	情報技術
NETAPP INC	16	60	6,688	情報技術
NIKE INC -CL B	73.5	401	44,080	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	16.5	195	21,414	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12.5	102	11,287	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6.5	51	5,629	金融
ALLY FINANCIAL INC	19	37	4,167	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	9.5	246	27,065	資本財・サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	16	137	15,085	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	31.5	106	11,654	素材
MCKESSON CORP	12.5	204	22,406	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	18	84	9,286	情報技術
XYLEM INC	7.5	40	4,415	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	88	1,053	115,622	生活必需品
NUCOR CORP	17	100	11,025	素材
WESTERN UNION CO	21	40	4,430	情報技術
NEWELL BRANDS INC	28.08	153	16,877	一般消費財・サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	44.5	267	29,353	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	5	43	4,821	一般消費財・サービス
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	2	26	2,894	生活必需品
PAYCHEX INC	16.5	99	10,878	情報技術
PATTERSON COS INC	3	14	1,538	ヘルスケア
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5.5	128	14,140	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	107.5	814	89,346	生活必需品
P G & E CORP	29	198	21,748	公益事業
PFIZER INC	336.58	1,100	120,722	ヘルスケア
ALKERMES PLC	10.5	62	6,851	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	25.5	120	13,253	公益事業
STRYKER CORP	19	269	29,579	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	7.7	120	13,271	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9.5	156	17,184	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	4	35	3,869	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	142.7	1,262	138,470	生活必需品
EXELON CORP	50.54	185	20,345	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	12	141	15,536	ヘルスケア
NVR INC	0.2	49	5,393	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	68.5	311	34,136	エネルギー
PEPSICO INC	80.85	948	104,117	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	23.5	254	27,872	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9.5	77	8,476	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	35.5	451	49,564	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6	39	4,283	金融
PENTAIR PLC	10.25	68	7,478	資本財・サービス
QUALCOMM INC	84	478	52,543	情報技術
INVESCO LTD	25.5	88	9,702	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	5	65	7,164	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18	117	12,908	金融
RAYTHEON COMPANY	16	259	28,520	資本財・サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4.5	30	3,296	一般消費財・サービス
RED HAT INC	10	88	9,756	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	4.5	214	23,543	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	11	70	7,742	資本財・サービス
PRICELINE GROUP INC/THE	2.7	494	54,260	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	21.5	131	14,413	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	5.5	57	6,333	素材
RESMED INC	9.5	71	7,854	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	8.5	91	10,000	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	8	38	4,200	資本財・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	46.98	309	33,912	生活必需品
RALPH LAUREN CORP	4	28	3,098	一般消費財・サービス

銘柄	2017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		
AUTONATION INC	6.5	27	3,006	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	8.01	85	9,359	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	69.5	100	11,057	金融
CHEVRON CORP	107	1,140	125,148	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	19	153	16,860	公益事業
TESLA INC	7.5	285	31,324	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	30	87	9,575	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	8.02	113	12,458	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	8	59	6,525	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	12.53	423	46,513	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	20	70	7,783	不動産
TWITTER INC	38	63	6,987	情報技術
SOUTHERN CO/THE	55	281	30,909	公益事業
SYSCO CORP	30.5	169	18,546	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	15	191	21,059	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	10	54	5,933	金融
STERICYCLE INC	5	39	4,292	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	13	45	4,939	素材
SCHLUMBERGER LTD	78.93	538	59,045	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10.5	44	4,906	資本財・サービス
AT&T INC	342.7	1,326	145,591	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	9	53	5,878	資本財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4.6	162	17,800	素材
SEMPRA ENERGY	14	160	17,574	公益事業
TIFFANY & CO	7.5	68	7,529	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	17	70	7,699	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	56.5	452	49,692	情報技術
SALESFORCE.COM INC	36.5	318	34,909	情報技術
SIGNET JEWELERS LTD	4	23	2,631	一般消費財・サービス
WESTROCK CO	12.12	68	7,553	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	53.53	224	24,585	資本財・サービス
TESORO CORP	7.5	69	7,581	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	45	494	54,212	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	39	49	5,408	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	30	160	17,560	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	43	516	56,620	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	39.5	432	47,408	資本財・サービス
UNUM GROUP	12	56	6,201	金融
SPRINT CORP	41.14	33	3,674	電気通信サービス
ANTERO RESOURCES CORP	10	21	2,400	エネルギー
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	6.53	56	6,186	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	11	41	4,509	金融
AMEREN CORPORATION	13	73	8,046	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	54.5	993	109,046	ヘルスケア
VERISIGN INC	4.5	41	4,525	情報技術
VALERO ENERGY CORP	27	174	19,181	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	3.3	99	10,942	一般消費財・サービス
FNF GROUP	17.5	75	8,237	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4	46	5,130	ヘルスケア
ANTHEM INC	15	283	31,067	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	89	944	103,646	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	268.87	1,466	160,865	金融
FOOT LOCKER INC	7	37	4,129	一般消費財・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	24	176	19,333	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	48	138	15,162	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5	28	3,078	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	3.5	68	7,547	一般消費財・サービス
WAL-MART STORES INC	84.5	675	74,078	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	12.5	157	17,226	ヘルスケア
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	64	26	2,914	エネルギー
WYNN RESORTS LTD	5	66	7,323	一般消費財・サービス
XEROX CORP	37.59	26	2,858	情報技術
WABTEC CORP	5	44	4,829	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	37	270	29,704	一般消費財・サービス
WATERS CORP	4.5	83	9,132	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	3.5	27	2,978	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	19.09	444	48,811	ヘルスケア
WHOLE FOODS MARKET INC	15	53	5,834	生活必需品
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	52	430	47,286	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8.13	120	13,200	金融
WESTERN DIGITAL CORP	16.95	148	16,328	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	17	108	11,892	公益事業
WESTAR ENERGY INC	9	47	5,260	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27	119	13,114	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	105	1,000	109,814	情報技術
PPL CORP	39	153	16,812	公益事業
PULTEGROUP INC	19	46	5,061	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	14.6	162	17,861	素材
NORTHERN TRUST CORP	12.5	116	12,804	金融
NVIDIA CORP	31	470	51,604	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	28.53	353	38,806	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	2017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 INTERACTIVE CORP Q-A	29	70	7,716	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12	39	4,280	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	15.5	96	10,630	生活必需品
NETFLIX INC	25	380	41,748	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21.5	375	41,180	ヘルスケア
TORCHMARK CORP	6.5	50	5,487	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9	90	9,961	金融
TEXTRON INC	16	75	8,321	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	56.5	155	17,115	一般消費財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	17	46	5,060	一般消費財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	29	39	4,320	一般消費財・サービス
OGE ENERGY CORP	12	42	4,692	公益事業
OMNICOM GROUP	13.5	111	12,206	一般消費財・サービス
ORACLE CORP	175	784	86,039	情報技術
MASTERCARD INC - A	54.5	667	73,251	情報技術
ONEOK INC	9.5	47	5,189	エネルギー
CENTURYLINK INC	27.97	76	8,381	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	6	137	15,064	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	21	153	16,829	一般消費財・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2.5	60	6,673	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	9.5	83	9,185	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	24	71	7,802	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	557.63	1,324	145,371	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11	101	11,094	ヘルスケア
NORDSTROM INC	8	37	4,153	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	42	339	37,253	金融
ANALOG DEVICES INC	20.44	165	18,152	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	37	43	4,778	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	17.08	69	7,651	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	56.2	361	39,618	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	29	137	15,043	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	9.5	97	10,680	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8.5	94	10,411	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	12	36	3,957	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	7	29	3,237	ヘルスケア
AVERY DENNISON CORP	6.5	55	6,094	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	34	225	24,796	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	35	209	23,037	資本財・サービス
AON PLC	15	202	22,219	金融
AMGEN INC	41	676	74,270	ヘルスケア
CORE LABORATORIES N. V.	4	41	4,599	エネルギー
COACH INC	18	83	9,142	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	26.62	200	22,004	資本財・サービス
CELGENE CORP	43	520	57,106	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10	179	19,738	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	63.1	277	30,448	情報技術
CIT GROUP INC	9	42	4,644	金融
CIMAREX ENERGY CO	4.5	43	4,814	エネルギー
CME GROUP INC	18.5	235	25,843	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	21.89	71	7,870	エネルギー
ECOLAB INC	15	200	22,033	素材
EQUIFAX INC	6.5	91	10,056	資本財・サービス
GAP INC/THE	13	30	3,316	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	72	467	51,341	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	10.76	100	11,066	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	13.5	46	5,142	生活必需品
STATE STREET CORP	22.5	199	21,919	金融
STAPLES INC	38	34	3,744	一般消費財・サービス
SUNTRUST BANKS INC	28	158	17,336	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	67.5	285	31,327	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	29.5	171	18,766	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	13	74	8,128	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	8	46	5,076	素材
CARDINAL HEALTH INC	18.5	139	15,347	ヘルスケア
FEDEX CORP	15	313	34,380	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27	216	23,726	金融
FMC CORP	7.5	56	6,239	素材
FLEX LTD	25	41	4,572	情報技術
CERNER CORP	18.5	122	13,386	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4	54	5,991	素材
CITRIX SYSTEMS INC	9.5	75	8,335	情報技術
INTEL CORP	265.5	943	103,501	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	17	41	4,573	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	22	114	12,515	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	18	264	28,980	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	80	41	4,529	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC	7.5	129	14,202	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	8.5	38	4,210	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	2.2	199	21,865	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8.5	94	10,360	情報技術
SNAP-ON INC	3	47	5,168	資本財・サービス

銘柄	2017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	
CARMAX INC	12	74	8,140	一般消費財・サービス
COMERICA INC	11	81	8,962	金融
INGREDION INC	3	36	3,983	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	37.88	326	35,876	公益事業
TARGET CORP	31	179	19,680	一般消費財・サービス
DOVER CORP	8.5	69	7,628	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	2.5	44	4,855	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6	32	3,593	資本財・サービス
CINTAS CORP	5.5	70	7,721	資本財・サービス
CA INC	22	69	7,659	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	25	97	10,686	生活必需品
CLOROX COMPANY	6.5	90	9,921	生活必需品
ENTERGY CORP	11	87	9,585	公益事業
MICROSOFT CORP	412	2,895	317,653	情報技術
INCYTE CORP	8.5	102	11,199	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	58.5	472	51,862	生活必需品
MEDTRONIC PLC	76.06	666	73,146	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	58.5	181	19,936	情報技術
BLACKROCK INC	6.5	273	30,059	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	19	53	5,914	公益事業
HASBRO INC	6	65	7,196	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	14.5	106	11,691	生活必需品
KEYCORP	56	105	11,551	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	5	50	5,539	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	88	402	44,153	生活必需品
KOHL'S CORP	7.5	28	3,099	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	2.5	59	6,555	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	23	31	3,442	金融
APACHE CORP	19	90	9,948	エネルギー
CHUBB LTD	26.1	382	42,007	金融
ARROW ELECTRONICS INC	4.5	34	3,796	情報技術
ALLSTATE CORP	21.5	190	20,952	金融
EBAY INC	58.5	201	22,144	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC	65.5	339	37,298	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	9	74	8,184	素材
XILINX INC	12.5	81	8,898	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	33.35	210	23,096	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP-A	15	97	10,677	一般消費財・サービス
ZIONS BANCORPORATION	12	51	5,691	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11.5	111	12,259	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	12	46	5,150	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	13	47	5,240	情報技術
LENNAR CORP-A	14	75	8,284	一般消費財・サービス
LEAR CORP	4	58	6,443	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	14	52	5,741	金融
PROGRESSIVE CORP	30.5	135	14,861	金融
PRAXAIR INC	16	216	23,732	素材
PACCAR INC	19	121	13,319	資本財・サービス
PVH CORP	3.5	37	4,087	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	12.5	316	34,749	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	5.5	88	9,693	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	80.5	485	53,233	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC	9	65	7,141	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	18.5	115	12,676	公益事業
INTUIT INC	14	196	21,534	情報技術
BORGWARNER INC	9	38	4,269	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	17	97	10,721	一般消費財・サービス
BALL CORP	18.92	78	8,569	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	77.5	215	23,656	ヘルスケア
BED BATH & BEYOND INC	9.5	34	3,765	一般消費財・サービス
XL GROUP LTD	12	51	5,636	金融
ELECTRONIC ARTS INC	16.5	181	19,917	情報技術
VULCAN MATERIALS CO	7.5	96	10,632	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13	162	17,788	ヘルスケア
VF CORP	21	118	13,022	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	22	133	14,661	一般消費財・サービス
VIACOM INC-CLASS B	20	69	7,658	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	3.5	85	9,362	一般消費財・サービス
VCA INC	4.5	41	4,566	ヘルスケア
NUANCE COMMUNICATIONS INC	21	38	4,262	情報技術
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6	61	6,746	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	20	129	14,210	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	267	1,097	120,374	一般消費財・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	11	45	4,990	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	15	99	10,901	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	60	46	5,101	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	17,296.49	120,207	13,189,115
	銘柄数 < 比率 >	604銘柄		<60.5%>

銘柄	2017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		
(カナダ)				
IMPERIAL OIL LTD	14	53	4,448	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1.5	103	8,590	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9.38	26	2,237	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	14.21	111	9,229	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	22	56	4,664	素材
INTACT FINANCIAL CORP	7	64	5,372	金融
BCE INC	9	53	4,425	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	11	103	8,583	素材
SUNCOR ENERGY INC	97.12	382	31,718	エネルギー
METRO INC	16	70	5,835	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	23	123	10,264	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	70	540	44,828	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	25	263	21,856	金融
TORONTO-DOMINION BANK	111	718	59,538	金融
GREAT-WEST LIFE CO INC	17	58	4,812	金融
ROYAL BANK OF CANADA	89	830	68,873	金融
TOURMALINE OIL CORP	13	34	2,879	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	4	17	1,490	エネルギー
TRANSCANADA CORP	51	319	26,463	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	27	116	9,688	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	47	11	942	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	65	137	11,368	素材
CAE INC	7	15	1,271	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	20.2	119	9,880	金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	58	128	10,648	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	18	35	2,951	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6	35	2,947	素材
VERESEN INC	25	45	3,810	エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10	67	5,606	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	19	18	1,560	金融
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	11	26	2,183	エネルギー
HYDRO ONE LTD	15	35	2,905	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	14.89	112	9,302	生活必需品
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	40	3,381	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	22	137	11,399	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	12	74	6,184	素材
KINROSS GOLD CORP	105.34	57	4,767	素材
BANK OF MONTREAL	41	378	31,347	金融
POWER CORP OF CANADA	16	46	3,868	金融
METHANEX CORP	6	32	2,696	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	5	56	4,684	情報技術
TRISURA GROUP LTD-WI	0.32	0	58	金融
CAMECO CORP	28	34	2,843	エネルギー
TELUS CORP	3	13	1,108	電気通信サービス
POWER FINANCIAL CORP	10	33	2,737	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	28	62	5,203	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3	44	3,662	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	80	27	2,247	素材
AGRIUM INC	9	111	9,218	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	68	254	21,058	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1	57	4,732	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	24	143	11,934	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	2	24	1,989	生活必需品
BLACKBERRY LTD	27	37	3,126	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	34	154	12,772	金融
ENBRIDGE INC	96	478	39,636	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	55	278	23,091	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	125	299	24,856	金融
GOLDCORP INC	63	109	9,117	素材
ENCANA CORP	69	85	7,052	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10	203	16,888	資本財・サービス
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	4	21	1,749	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	14	57	4,725	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	45	470	38,964	資本財・サービス
CGI GROUP INC - CLASS A	13	85	7,078	情報技術
HUSKY ENERGY INC	30.12	46	3,872	エネルギー
ONEX CORPORATION	3	29	2,464	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	22	66	5,499	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	7	17	1,488	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	9	47	3,910	資本財・サービス
IGM FINANCIAL INC	3	12	995	金融
OPEN TEXT CORP	14	59	4,928	情報技術
CI FINANCIAL CORP	20	53	4,459	金融
SAPUTO INC	13	54	4,516	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33	36	2,984	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	25	153	12,717	生活必需品
YAMANA GOLD INC	52	17	1,431	素材
FORTIS INC	22	99	8,280	公益事業
CRESCENT POINT ENERGY CORP	25	27	2,314	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	45	49	4,084	エネルギー

銘柄	2017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	
DOLLARAMA INC	6	73	6,109	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	8	40	3,329	公益事業
ALTAGAS LTD	8	24	1,992	エネルギー
KEYERA CORP	7	29	2,405	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	7	16	1,397	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	20	51	4,265	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	28	46	3,845	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,383.08 87銘柄	9,804 812,657	<3.7%>
	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
(オーストラリア)				
HEALTHSCOPE LTD	160	35	2,918	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	62	5,246	金融
BHP BILLITON LIMITED	191.58	453	37,796	素材
SOUTH32 LTD	362.13	100	8,353	素材
LENLEASE GROUP	20	32	2,739	不動産
ALUMINA LTD	121	23	1,990	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	43	133	11,144	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	105	51	4,258	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	36	39	3,303	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	160.21	485	40,440	金融
WESTPAC BANKING CORP	191	598	49,819	金融
SANTOS LTD	96	30	2,550	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	178.38	510	42,516	金融
RIO TINTO LTD	24	150	12,509	素材
ORIGIN ENERGY LTD	120.5	88	7,406	エネルギー
AMCOR LIMITED	74.96	122	10,194	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	85	47	3,921	資本財・サービス
OIL SEARCH LTD	84	57	4,805	エネルギー
SEEK LTD	26	43	3,592	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	27.86	37	3,134	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	39	85	7,093	素材
INCITEC PIVOT LTD	73	26	2,176	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	103	847	70,595	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	20	64	5,343	エネルギー
ORICA LTD	20	41	3,461	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	88	116	9,703	金融
CIMIC GROUP LTD	10	39	3,288	資本財・サービス
WOOLWORTHS LTD	76.65	201	16,781	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	26	23	1,966	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	24	10	915	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	30	38	3,227	一般消費財・サービス
TELSTRA CORP LTD	207	90	7,516	電気通信サービス
AMP LTD	165.13	84	7,013	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	32	65	5,455	素材
MACQUARIE GROUP LTD	16.81	151	12,641	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	40.5	93	7,777	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	30	33	2,810	金融
CSL LTD	27.48	390	32,506	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	69.85	285	23,797	生活必需品
COCHLEAR LTD	2	30	2,581	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	32.12	40	3,373	素材
SUNCORP GROUP LTD	67	97	8,112	金融
BORAL LTD	86	61	5,113	素材
ASX LTD	13	67	5,636	金融
COMPUTERSHARE LTD	37	54	4,545	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	117	75	6,274	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	25	60	4,998	ヘルスケア
TRANSURBAN GROUP	115.22	147	12,253	資本財・サービス
CHALLENGER LTD	25	33	2,758	金融
SYDNEY AIRPORT	38	28	2,398	資本財・サービス
TATTS GROUP LTD	80	33	2,818	一般消費財・サービス
AGL ENERGY LTD	40.5	103	8,600	公益事業
BRAMBLES LTD	113.37	118	9,885	資本財・サービス
APA GROUP	75	72	6,021	公益事業
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9	63	5,273	ヘルスケア
REA GROUP LTD	6.08	39	3,298	一般消費財・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	6.21	32	2,740	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 >	4,320.78 57銘柄	6,957 579,400	<2.7%>
	百株	千香港ドル	千円	
(香港)				
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	60	420	5,913	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	120	580	8,163	一般消費財・サービス
MTR CORP	75	328	4,616	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	90	1,086	15,284	不動産
SINO LAND CO	120	161	2,269	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	155.52	1,538	21,640	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	80	546	7,693	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	35	272	3,838	不動産
CLP HOLDINGS LTD	100	827	11,642	公益事業

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	2017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	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	95.59	435	6,126	不動産
HANG LUNG GROUP LTD	80	271	3,821	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	510.96	746	10,496	公益事業
HANG SENG BANK LTD	47	763	10,745	金融
WHEELOCK & CO LTD	60	372	5,246	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	320	338	4,763	不動産
WH GROUP LTD	585	440	6,197	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	70	1,404	19,757	金融
LI & FUNG LTD	700	202	2,846	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	120	244	3,444	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20	225	3,177	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	80	255	3,596	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	150	227	3,203	資本財・サービス
BANK OF EAST ASIA LTD	86	288	4,059	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	60	227	3,203	不動産
SJM HOLDINGS LTD	100	85	1,195	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	80	205	2,892	不動産
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	145.52	888	12,499	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	20	131	1,855	公益事業
AIA GROUP LTD	712	3,983	56,049	金融
SANDS CHINA LTD	102	378	5,331	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	40	51	727	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	55	199	2,812	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	220	766	10,787	金融
WYNN MACAU LTD	60	110	1,551	一般消費財・サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	340	344	4,841	電気通信サービス
香港ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,694.59 35銘柄	19,352 <1.2%>	
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	90	213	16,985	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	108	222	17,723	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	20	20	1,600	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	93	59	4,736	資本財・サービス
CITY DEVELOPMENTS LTD	10	10	852	不動産
CAPITALAND LTD	190	68	5,451	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	120	37	3,022	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9	40	3,232	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	184	197	15,720	金融
GENTING SINGAPORE PLC	450	52	4,178	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	477	179	14,332	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	53	4,236	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	40	12	1,001	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	90	3	268	生活必需品
SINGAPORE EXCHANGE LTD	69	50	4,014	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	100	24	1,928	資本財・サービス
STARHUB LTD	120	33	2,639	電気通信サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	55	4,432	生活必需品
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	190	55	4,436	不動産
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,659 19銘柄	1,390 <0.5%>	
(ニュージーランド)	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	150	43	3,470	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	62	4,986	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81	56	4,482	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	19	14	1,161	素材
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	418.6 4銘柄	177 <0.1%>	
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT	50	24	3,452	一般消費財・サービス
TUI AG-DI	26	30	4,212	一般消費財・サービス
BP PLC	1,093.61	504	70,628	エネルギー
UNILEVER PLC	70.14	297	41,627	生活必需品
BARCLAYS PLC	931.5	189	26,521	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	107.7	96	13,501	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	105	38	5,425	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	5	37	5,222	素材
PRUDENTIAL PLC	148	261	36,609	金融
INMARSAT PLC	12	9	1,371	電気通信サービス
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	151.7	37	5,303	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	10.3	31	4,435	素材
BAE SYSTEMS PLC	157	103	14,486	資本財・サービス
AVIVA PLC	231.94	123	17,296	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	267	449	62,926	ヘルスケア
WORLDPAY GROUP PLC	135.17	42	5,957	情報技術
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	29	23	3,282	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	42	17	2,390	情報技術
DCC PLC	5	36	5,110	資本財・サービス
CONVATEC GROUP PLC	65.81	21	2,983	ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC	32.5	14	2,005	資本財・サービス

銘柄	2017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	
RELX PLC	53	89	12,546	資本財・サービス
DIAGEO PLC	140.55	327	45,847	生活必需品
RIO TINTO PLC	66.36	208	29,176	素材
STANDARD CHARTERED PLC	191.5	144	20,258	金融
TESCO PLC	467.5	86	12,159	生活必需品
FRESNILLO PLC	8	13	1,880	素材
SMITH & NEPHEW PLC	43	57	8,091	ヘルスケア
GLENCORE PLC	667.25	191	26,760	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15	20	2,912	金融
SMITHS GROUP PLC	22.6	36	5,062	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	6	5	760	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	47	17	2,395	金融
DIXONS CARPHONE PLC	47	15	2,106	一般消費財・サービス
PEARSON PLC	43	31	4,343	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	68.5	18	2,564	生活必需品
NEXT PLC	6	25	3,610	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	170	30	4,305	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	9.5	38	5,352	一般消費財・サービス
IMI PLC	24.1	30	4,214	資本財・サービス
BUNZL PLC	19	45	6,361	資本財・サービス
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	77.05	22	3,186	金融
GKN PLC	92	32	4,510	一般消費財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	1,474.61	328	45,987	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	8.03	31	4,461	素材
KINGFISHER PLC	97	30	4,211	一般消費財・サービス
WPP PLC	77	129	18,141	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	36.9	36	5,049	公益事業
SEVERN TRENT PLC	13	32	4,516	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	37.29	293	41,033	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	27	32	4,540	金融
SCHROEDERS PLC	5.5	17	2,403	金融
TATE & LYLE PLC	20	14	2,039	生活必需品
SSE PLC	61.06	90	12,720	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	13	23	3,337	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	59	35	4,903	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	69	365	51,174	ヘルスケア
WOLSELEY PLC	16	77	10,812	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	316.5	81	11,437	金融
3I GROUP PLC	57.37	51	7,183	金融
SKY PLC	63	60	8,519	一般消費財・サービス
ASHTREAD GROUP PLC	26	41	5,736	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	58.79	41	5,741	情報技術
NATIONAL GRID PLC	182.61	185	25,944	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,981.25	270	37,821	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	63.8	39	5,574	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	54.2	194	27,170	生活必需品
CENTRICA PLC	268	54	7,607	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7	22	3,180	一般消費財・サービス
PROVIDENT FINANCIAL PLC	5.5	16	2,287	金融
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	104.57	569	79,677	生活必需品
BHP BILLITON PLC	116.84	137	19,265	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	19.5	58	8,244	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	1,111	756	105,808	金融
SHIRE PLC	50.68	216	30,351	ヘルスケア
OLD MUTUAL PLC	307.12	62	8,795	金融
ANGLO AMERICAN PLC	71	75	10,519	素材
MONDI PLC	19	38	5,446	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	145	35	4,964	生活必需品
CARNIVAL PLC	9.5	48	6,765	一般消費財・サービス
COMPASS GROUP PLC	95.58	159	22,252	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	16	38	5,421	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	487.03	144	20,285	電気通信サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	12	27	3,879	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	21	36	5,068	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	8.55	37	5,274	一般消費財・サービス
CAPITA PLC	49	31	4,473	資本財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC	17	26	3,777	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	10	43	6,063	資本財・サービス
ITV PLC	151.5	27	3,917	一般消費財・サービス
PETROFAC LTD	9	3	510	エネルギー
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20.35	73	10,340	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	243.97	512	71,732	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	211.47	452	63,374	エネルギー
MEGGITT PLC	35	17	2,455	資本財・サービス
G4S PLC	113.2	37	5,177	資本財・サービス
COBHAM PLC	196.77	26	3,691	資本財・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	10	16	2,340	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	33	4,645	金融
INVESTEC PLC	46	26	3,761	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	2017年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
ANTOFAGASTA PLC	7	5	780	素材
STANDARD LIFE PLC	92.09	36	5,042	金融
EXPERIAN PLC	56.18	91	12,733	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 >	16,937.29	10,389	1,453,532
		103銘柄		<6.7%>
(イスラエル)	株数	千イスラエル・シェケル	千円	
AZRIELI GROUP LTD	5.3	102	3,204	不動産
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	50	31	972	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	3	133	4,167	資本財・サービス
BANK HAPOLIM BM	79	190	5,930	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	114	195	6,075	金融
NICE LTD	2	56	1,753	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 >	253.3	709	22,104
		6銘柄		<0.1%>
(スイス)	株数	千スイス・フラン	千円	
DUFREY AG-REG	1.89	30	3,416	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	219.85	342	38,744	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.5	34	3,843	素材
ADECCO GROUP AG-REG	10.87	79	9,025	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	41.3	1,032	116,688	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	3.89	28	3,271	金融
SIKA AG-BR	0.1	62	7,094	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	69	7,890	生活必需品
ABB LTD-REG	118.84	289	32,704	資本財・サービス
SWISS RE AG	17.5	154	17,456	金融
NESTLE SA-REG	183	1,475	166,731	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1.05	62	7,093	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3	61	6,930	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	141.81	186	21,114	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	10.5	53	5,996	金融
SGS SA-REG	0.32	75	8,473	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	3.69	40	4,610	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1.8	66	7,497	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	8.3	238	26,901	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	3.2	48	5,426	金融
NOVARTIS AG-REG	131.45	1,032	116,646	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.2	27	3,077	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	31.25	248	28,065	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	1.2	55	6,240	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG	2.34	105	11,893	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	0.5	99	11,234	素材
ACTELION LTD-REG	6.25	165	18,710	ヘルスケア
STRAUMANN HOLDING AG-REG	0.52	28	3,195	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	3	49	5,592	ヘルスケア
LONZA GROUP AG-REG	3.95	79	8,933	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	32	3,690	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	26.3	148	16,801	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1.5	48	5,517	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	3	47	5,368	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	4.5	40	4,595	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.03	17	1,960	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	991.91	6,660	752,436
		36銘柄		<3.4%>
(デンマーク)	株数	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	109.5	3,197	52,948	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	40	1,002	16,599	金融
ISS A/S	13.2	358	5,932	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.1	120	1,997	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	13.38	818	13,549	資本財・サービス
TDC A/S	68	258	4,283	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B	5.5	392	6,507	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	11	332	5,512	素材
COLOPLAST-B	6.5	376	6,237	ヘルスケア
DSV A/S	12	490	8,117	資本財・サービス
WILLIAM DEMANT HOLDING	13.14	224	3,723	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.43	542	8,986	資本財・サービス
PANDORA A/S	7.5	492	8,159	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	7.5	360	5,967	素材
GENMAB A/S	3	423	7,019	ヘルスケア
DONG ENERGY A/S	8	241	3,995	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 >	318.75	9,634	159,539
		16銘柄		<0.7%>
(ノルウェー)	株数	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA	74.5	338	4,405	素材
DNB ASA	46	662	8,631	金融
ORKLA ASA	42	355	4,632	生活必需品
TELENOR ASA	46	644	8,391	電気通信サービス
STATOIL ASA	60.5	888	11,572	エネルギー

銘柄		2017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	千ノルウェー・クローネ	千円	
YARA INTERNATIONAL ASA		8.5	268	3,499	素材
MARINE HARVEST		23.5	341	4,452	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		20	274	3,580	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS		17	314	4,097	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 >	338 9銘柄	4,087 53,263	<0.2%>
(スウェーデン)		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ERICSSON LM-B SHS		167	1,038	13,098	情報技術
VOLVO AB-B SHS		85	1,234	15,563	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		2	101	1,278	電気通信サービス
SKF AB-B SHARES		21	376	4,748	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B		15	425	5,369	一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB		174	1,931	24,354	金融
SWEDISH MATCH AB		12	363	4,589	生活必需品
TELE2 AB-B SHS		32.58	292	3,689	電気通信サービス
GETINGE AB-B SHS		19	330	4,161	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		96	1,000	12,614	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		81	991	12,502	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		56	1,170	14,758	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		55	1,167	14,717	一般消費財・サービス
SKANSKA AB-B SHS		18	371	4,687	資本財・サービス
SANDVIK AB		63.5	868	10,954	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		26.2	1,074	13,545	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		40.5	1,308	16,495	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS		25	372	4,690	資本財・サービス
TELIA CO AB		158	622	7,849	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB		20	345	4,352	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		25	725	9,145	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		55	1,057	13,336	資本財・サービス
LUNDIN PETROLEUM AB		8	134	1,692	エネルギー
BOLIDEN AB		18	421	5,309	素材
HUSQVARNA AB-B SHS		24	203	2,569	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B		15	394	4,978	金融
HEXAGON AB-B SHS		17	711	8,971	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		13	271	3,417	金融
スウェーデン・クローネ通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,341.78 28銘柄	19,305 243,443	<1.1%>
ユーロ (アイルランド)		百株	千ユーロ	千円	
BANK OF IRELAND		1,570	35	4,329	金融
KERRY GROUP PLC-A		9.5	73	9,108	生活必需品
CRH PLC		42.5	137	16,886	素材
PADDY POWER BETFAIR PLC		4.6	45	5,589	一般消費財・サービス
国小計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,626.6 4銘柄	291 35,914	<0.2%>
ユーロ (オランダ)		百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N. V.		12.99	39	4,879	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		51.5	165	20,393	資本財・サービス
NN GROUP NV		15	47	5,900	金融
UNILEVER NV-CVA		93.53	459	56,593	生活必需品
HEINEKEN NV		14.9	129	15,922	生活必需品
RELX NV		64	118	14,552	資本財・サービス
AEGON NV		143.61	64	7,952	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		76.26	146	18,067	生活必需品
AKZO NOBEL		14	108	13,322	素材
KONINKLIJKE DSM NV		10.5	69	8,615	素材
WOLTERS KLUWER		16.5	64	7,886	資本財・サービス
BOSKALIS WESTMINSTER		9.1	27	3,335	資本財・サービス
ING GROEP NV		210.51	316	38,938	金融
KONINKLIJKE KPN NV		239	72	8,915	電気通信サービス
ASML HOLDING NV		21.1	246	30,314	情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA		13	29	3,640	金融
VOPAK		6.3	26	3,314	エネルギー
RANDSTAD HOLDING NV		7.5	38	4,793	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		6	49	6,057	生活必需品
GEMALTO		7	38	4,709	情報技術
ALTICE NV - A		13.5	30	3,769	一般消費財・サービス
ALTICE NV - B		15	33	4,184	一般消費財・サービス
AIRBUS SE		32.6	244	30,152	資本財・サービス
EXOR NV		4.5	22	2,736	金融
CNH INDUSTRIAL NV		73.53	72	8,970	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		70.44	68	8,398	一般消費財・サービス
FERRARI NV		8.3	65	8,026	一般消費財・サービス
国小計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,250.17 27銘柄	2,797 344,344	<1.6%>
ユーロ (ベルギー)		百株	千ユーロ	千円	
UCB SA		7	43	5,332	ヘルスケア
KBC GROEP NV		13.8	93	11,459	金融
COLRUYT SA		3.5	16	2,061	生活必需品

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	2017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	
GROUP BRUXELLES LAMBERT SA	4	34	4,223	金融
SOLVAY SA	5.36	65	8,004	素材
UMICORE	8	49	6,099	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	41.2	416	51,329	生活必需品
AGEAS	9.5	34	4,302	金融
PROXIMUS	7	22	2,763	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	4.62	26	3,323	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	103.98 10銘柄	803 <0.5%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ルクセンブルグ)				
RTL GROUP	3.5	24	2,964	一般消費財・サービス
ARCELORMITTAL	43.44	80	9,933	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	0.6	29	3,599	ヘルスケア
SES	19	42	5,264	一般消費財・サービス
TENARIS SA	22	29	3,691	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	88.54 5銘柄	206 <0.1%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フランス)				
TOTAL SA	130.7	584	72,012	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	11.5	138	17,059	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	20.79	225	27,795	素材
KERING	4.3	129	15,883	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	30.5	204	25,127	資本財・サービス
BOUYGUES SA	12.5	47	5,900	資本財・サービス
BNP PARIBAS	61.93	386	47,575	金融
PEUGEOT SA	26	46	5,683	一般消費財・サービス
NATIXIS	76.74	44	5,491	金融
THALES SA	6	58	7,148	資本財・サービス
DANONE	31	206	25,417	生活必需品
CARREFOUR SA	33.1	77	9,576	生活必需品
SUEZ	29.5	48	5,988	公益事業
VIVENDI	56.46	112	13,797	一般消費財・サービス
L'OREAL	14.13	265	32,720	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	27.5	134	16,538	資本財・サービス
LEGRAND SA	13.5	81	10,041	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	2	10	1,326	生活必需品
PERNOD RICARD SA	13.03	158	19,466	生活必需品
SOCIETE BIC SA	1.5	16	2,012	資本財・サービス
EURAZEO SE	5.25	34	4,208	金融
REXEL SA	16	23	2,944	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA	41	190	23,395	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	14.73	335	41,327	一般消費財・サービス
ACCOR SA	10	42	5,170	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	9.3	85	10,572	情報技術
VALEO SA	15.12	91	11,283	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	13	87	10,738	一般消費財・サービス
BUREAU VERITAS SA	17	34	4,292	資本財・サービス
EIFFAGE	4	33	4,087	資本財・サービス
SODEXO SA	4.5	54	6,650	一般消費財・サービス
IPSEN	2.76	32	3,948	ヘルスケア
INGENICO GROUP	2	16	1,997	情報技術
ZODIAC AEROSPACE	8	18	2,335	資本財・サービス
SEB SA	1.97	31	3,823	一般消費財・サービス
ESSILOR INTERNATIONAL	11.76	141	17,380	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA	0.22	28	3,544	資本財・サービス
AXA SA	102	245	30,193	金融
CHRISTIAN DIOR SE	3.56	90	11,197	一般消費財・サービス
LAGARDERE SCA	12	33	4,155	一般消費財・サービス
EDENRED	8	18	2,317	資本財・サービス
RENAULT SA	12	99	12,217	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	1.46	64	7,898	一般消費財・サービス
ATOS SE	4.5	57	7,032	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA	6	49	6,071	情報技術
WENDEL	2.01	27	3,423	金融
ORANGE	103	153	18,836	電気通信サービス
ALSTOM	13.1	40	5,000	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	13.49	26	3,309	金融
SANOFI	64.93	550	67,833	ヘルスケア
VINCI SA	28.06	220	27,134	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	25	48	6,004	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	59	81	10,092	金融
ENGIE	98.26	135	16,741	公益事業
IMERYS SA	3.4	26	3,282	素材
EDF	34	33	4,106	公益事業
SAFRAN SA	15.5	120	14,887	資本財・サービス
ILIAD SA	1	21	2,707	電気通信サービス
ARKEMA	4.8	45	5,652	素材
ADP	1	13	1,701	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	14	33	4,170	一般消費財・サービス
SCOR SE	6	20	2,558	金融

銘柄		2017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	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR		39.4	40	4,932	資本財・サービス
BOLLORE		73	29	3,687	資本財・サービス
国小計		1,527.76	6,590	811,417	
株数、金額 銘柄数 < 比率 >		64銘柄		<3.7%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ドイツ)					
BAYER AG-REG		45.1	547	67,432	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		6	17	2,176	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		103.5	158	19,463	金融
COMMERZBANK AG		49.9	46	5,713	金融
VOLKSWAGEN AG		2.2	30	3,737	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		9.88	130	16,104	一般消費財・サービス
MAN SE		1	9	1,164	資本財・サービス
SIEMENS AG-REG		42.48	538	66,286	資本財・サービス
E. ON SE		128.43	113	13,940	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		17	142	17,603	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		13	48	5,960	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG		6.45	44	5,505	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		6.2	123	15,177	一般消費財・サービス
BASF SE		50.45	434	53,525	素材
LINDE AG		10.13	180	22,192	素材
K+S AG-REG		14	33	4,120	素材
ALLIANZ SE-REG		25.6	445	54,822	金融
THYSSENKRUPP AG		15.5	36	4,554	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		9.2	116	14,327	生活必需品
RWE AG		33.07	65	8,061	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		17	32	3,945	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		4.6	35	4,315	資本財・サービス
BRENNTAG AG		8	41	5,051	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		22.08	173	21,387	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		9.59	46	5,775	情報技術
HOCHTIEF AG		1.66	27	3,440	資本財・サービス
SAP SE		54.48	513	63,213	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		8.99	160	19,744	金融
ZALANDO SE		7	30	3,745	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		9	77	9,581	素材
COVESTRO AG		4	26	3,203	素材
INNOGY SE		6	21	2,630	公益事業
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		8	40	5,001	一般消費財・サービス
BEIERSDORF AG		5	48	5,928	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF		7	35	4,324	素材
MERCK KGAA		8.12	87	10,736	ヘルスケア
ADIDAS AG		9.75	173	21,317	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		6.5	72	8,890	生活必需品
METRO AG		15	43	5,377	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		176.44	296	36,481	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		13.67	121	14,961	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		54.51	358	44,096	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		70.1	137	16,940	情報技術
HANNOVER RUECK SE		3.5	37	4,588	金融
DEUTSCHE POST AG-REG		51	167	20,637	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		10	94	11,573	金融
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE		15.6	58	7,195	一般消費財・サービス
LANXESS AG		6	41	5,107	素材
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR		23.63	83	10,219	不動産
SYMRISE AG		8.3	53	6,539	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		62.4	27	3,424	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		2.5	18	2,259	一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD		3.5	23	2,844	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		27.6	100	12,325	不動産
国小計		1,329.61	6,568	808,675	
株数、金額 銘柄数 < 比率 >		54銘柄		<3.7%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ポルトガル)					
JERONIMO MARTINS		8	14	1,779	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		151	47	5,898	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		36.09	48	5,913	エネルギー
国小計		195.09	110	13,591	
株数、金額 銘柄数 < 比率 >		3銘柄		<0.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (スペイン)					
TELEFONICA SA		232	226	27,850	電気通信サービス
ENDESA SA		21.5	46	5,776	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		360.02	263	32,399	金融
IBERDROLA SA		328.4	232	28,583	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		325.87	56	6,944	金融
BANKINTER SA		27	21	2,695	金融
REPSOL SA		65.67	92	11,427	エネルギー
GRIFOLS SA		17	43	5,310	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		817.68	484	59,694	金融
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		32.6	53	6,555	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	2017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		
AMADEUS IT GROUP SA	26	139	17,114		情報技術
GAS NATURAL SDG SA	21	45	5,593		公益事業
MAPFRE SA	80.05	26	3,203		金融
CAIXABANK S. A	219.87	88	10,857		金融
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	49	33	4,140		資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12	43	5,316		資本財・サービス
AENA SA	4	72	8,903		資本財・サービス
REPSOL SA-RTS	65.67	2	333		その他
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	55	193	23,844		一般消費財・サービス
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	17.93	35	4,426		資本財・サービス
ENAGAS SA	18.59	48	5,983		エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23	46	5,740		公益事業
FERROVIAL SA	26	53	6,558		資本財・サービス
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	32	18	2,233		生活必需品
BANKIA SA	72.87	29	3,663		金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,950.72 25銘柄	2,397	295,153	<1.4%>
	百株	千ユーロ	千円		
ユーロ (イタリア)					
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	130	25	3,157		金融
PRYSMIAN SPA	14.4	37	4,600		資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	75.23	109	13,438		金融
MEDIOBANCA SPA	44.6	38	4,680		金融
UNICREDIT SPA	107.93	171	21,086		金融
TELECOM ITALIA SPA	613	51	6,290		電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP	483.81	33	4,127		電気通信サービス
INTESA SANPAOLO	633.5	163	20,105		金融
ATLANTIA SPA	26.77	70	8,628		資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	29	18	2,295		金融
RECORDATI SPA	6.92	25	3,109		ヘルスケア
ENI SPA	127.1	176	21,671		エネルギー
LEONARDO SPA	25	39	4,841		資本財・サービス
ENEL SPA	443.29	215	26,489		公益事業
SNAM SPA	162	66	8,216		エネルギー
LUXOTTICA GROUP SPA	8	43	5,392		一般消費財・サービス
TERNA SPA	99	50	6,240		公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,029.55 17銘柄	1,335	164,373	<0.8%>
	百株	千ユーロ	千円		
ユーロ (フィンランド)					
UPM-KYMMENE OYJ	31.7	80	9,939		素材
NOKIA OYJ	319.94	182	22,431		情報技術
WARTSILA OYJ ABP	8.5	45	5,582		資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	20	23	2,868		素材
METSO OYJ	3	9	1,147		資本財・サービス
ELISA OYJ	13	45	5,611		電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS	29.29	133	16,486		金融
FORTUM OYJ	24	34	4,225		公益事業
KONE OYJ-B	19	89	10,970		資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ	7	25	3,191		一般消費財・サービス
NESTE OYJ	4	13	1,716		エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	5	28	3,545		ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	484.43 12銘柄	712	87,715	<0.4%>
	百株	千ユーロ	千円		
ユーロ (オーストリア)					
OMV AG	6	28	3,468		エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	20	64	7,951		金融
VOESTALPINE AG	8	32	3,940		素材
ANDRITZ AG	5.5	29	3,661		資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	39.5 4銘柄	154	19,021	<0.1%>
	百株	千ユーロ	千円		
ユーロ (その他)					
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	13	47	5,817		生活必需品
STMICROELECTRONICS NV	32	44	5,475		情報技術
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	45 2銘柄	91	11,293	<0.1%>
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,670.95 227銘柄	22,060	2,715,854	<12.5%>
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	65,624.52 1,231銘柄	—	20,378,537	<93.4%>

(注1) 邦貨換算金額は、2017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) 外国投資信託受益証券

銘柄	数	2017年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	70	29	3,264
合計	70 銘柄数 < 比率 >	29 1銘柄	3,264 <0.0%>

(注1) 邦貨換算金額は、2017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) 外国投資信託証券

銘柄	数	2017年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.722	141	15,474
SIMON PROPERTY GROUP INC	1.734	276	30,372
BOSTON PROPERTIES INC	0.85	107	11,808
GGP INC	4	96	10,550
VORNADO REALTY TRUST	0.856	80	8,835
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.8	106	11,666
EQUITY RESIDENTIAL	1.85	124	13,638
EQUINIX INC	0.404	174	19,153
AMERICAN TOWER CORP	2.35	306	33,648
HOST HOTELS & RESORTS INC	4.228	78	8,614
KIMCO REALTY CORP	1.8	34	3,803
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	3.5	49	5,441
VENTAS INC	2.1	144	15,829
WEYERHAEUSER CO	4.104	138	15,206
AGNC INVESTMENT CORP	2.1	45	4,986
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1.4	26	2,955
CROWN CASTLE INTL CORP	2.05	208	22,922
IRON MOUNTAIN INC	1.718	58	6,444
VEREIT INC	4.35	36	4,042
PROLOGIS INC	2.965	171	18,813
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.45	53	5,874
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.65	57	6,256
DUKE REALTY CORP	1.8	51	5,701
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.35	91	10,080
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.45	57	6,270
WELLTOWER INC	2	148	16,335
HCP INC	2.8	89	9,821
LIBERTY PROPERTY TRUST	1	42	4,649
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.7	76	8,362
MACERICH CO/THE	0.7	41	4,520
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	6.3	77	8,495
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	0.65	25	2,794
REALTY INCOME CORP	1.35	76	8,435
PUBLIC STORAGE	0.82	172	18,882
REGENCY CENTERS CORP	0.7	44	4,876
SL GREEN REALTY CORP	0.65	69	7,576
UDR INC	1.2	47	5,227
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.9	105	11,597
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.8	60	6,618
アメリカ・ドル通貨計	68.151 銘柄数 < 比率 >	3,796 39銘柄	416,584 <1.9%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1.4	35	2,913
カナダ・ドル通貨計	1.4 銘柄数 < 比率 >	35 1銘柄	2,913 <0.0%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円
SCENTRE GROUP	30.929	132	11,075
DEXUS	6.5	68	5,727
GPT GROUP	14.648	76	6,380
MIRVAC GROUP	13.9	31	2,650
STOCKLAND	14.3	68	5,740
WESTFIELD CORP	9.5	82	6,867
GOODMAN GROUP	8.8	75	6,302
VICINITY CENTRES	19.523	56	4,666
オーストラリア・ドル通貨計	118.1 銘柄数 < 比率 >	593 8銘柄	49,410 <0.2%>

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	数	2017年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(香港)	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT	13.5	858	12,080
香港ドル通貨計	13.5	858	12,080
	銘柄数 < 比率 >	1銘柄	<0.1% >
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	12	32	2,582
CAPITALAND MALL TRUST	9	17	1,387
シンガポール・ドル通貨計	21	49	3,970
	銘柄数 < 比率 >	2銘柄	<0.0% >
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	5,129	55	7,771
SEGRO PLC	5.92	29	4,166
HAMMERSON PLC	4.9	29	4,178
BRITISH LAND CO PLC	6.3	40	5,702
INTU PROPERTIES PLC	8,425	22	3,199
イギリス・ポンド通貨計	30,674	178	25,018
	銘柄数 < 比率 >	5銘柄	<0.1% >
(ユーロ (フランス))	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO SE	0.5	116	14,370
GECINA SA	0.14	19	2,388
KLEPIERRE	1.4	52	6,499
ユーロ通貨計	2.04	188	23,258
	銘柄数 < 比率 >	3銘柄	<0.1% >
合計	254,865	—	533,236
	銘柄数 < 比率 >	59銘柄	<2.4% >

(注1) 邦貨換算金額は、2017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。

(4) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2017年6月15日現在	
	買建額	売建額
外	百万円	百万円
S&P500 E-MINI FUTURE (アメリカ)	614	—
国		
FT 100 (イギリス)	83	—
EURO STOXX 50 (ドイツ)	126	—

(注1) 外貨建の評価額は、2017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9期 (決算日 2017年1月10日)

(計算期間 2016年1月13日~2017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9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

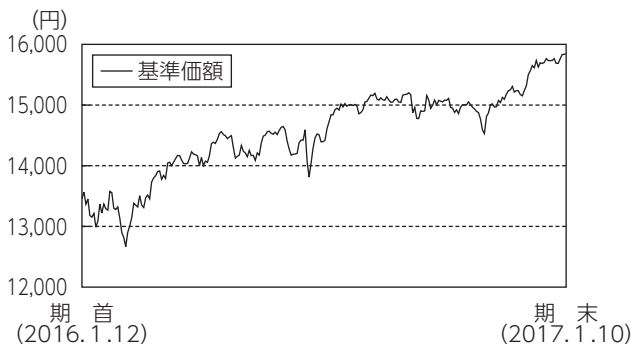
大和投資信託

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



が嫌気され、軟調な推移で始まりました。2016年3月以降は、原油価格が反発したことやECB(欧州中央銀行)による追加金融緩和の発表、FOMC(米連邦公開市場委員会)での利上げ見送りなどが好感され堅調に推移しました。6月下旬に英国の国民投票でEU(欧州連合)離脱派が多数となると欧州情勢への懸念が高まり、市況は一時的に急落しましたが、その後は英国および各国の中央銀行が政策協調を表明したことが好感され、落ち着きを取り戻し反発しました。7月以降は、米国企業の良好な決算内容などを受けて上昇基調となりましたが、米国の利上げ観測が台頭すると一進一退の展開となりました。11月に入ると、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことによる新政権の政策への期待から、市況は米国市場を中心に上昇基調となり期末を迎えました。

◆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おります。

◆ポートフォリオについて

外国株式(投資信託証券、株式先物を含む。以下同じ。)と為替予約の評価損益の合計の純資産総額に対する比率については、期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

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15.4%となりました。一方、当ファンドの騰落率は17.7%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おります。

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 組 入 率	株 式 先 物 率	投資信託証券組入比率	
	円	騰落率	円	騰落率			%	%
(期首)2016年1月12日	13,460	-	11,197	-	87.7	7.3	2.4	
1月末	13,269	△ 1.4	11,041	△ 1.4	91.8	7.6	2.6	
2月末	13,517	0.4	11,221	0.2	86.2	5.6	2.4	
3月末	14,229	5.7	11,780	5.2	92.0	6.5	2.6	
4月末	14,495	7.7	11,985	7.0	91.1	4.4	2.5	
5月末	14,568	8.2	12,002	7.2	94.0	6.7	2.6	
6月末	14,290	6.2	11,747	4.9	85.9	4.7	2.6	
7月末	14,992	11.4	12,320	10.0	94.0	4.4	2.8	
8月末	15,097	12.2	12,376	10.5	93.3	4.8	2.8	
9月末	15,006	11.5	12,287	9.7	91.9	3.6	2.7	
10月末	14,896	10.7	12,190	8.9	92.7	7.5	2.5	
11月末	15,238	13.2	12,449	11.2	94.0	10.3	2.3	
12月末	15,688	16.6	12,791	14.2	92.0	7.1	2.4	
(期末)2017年1月10日	15,841	17.7	12,919	15.4	91.1	5.6	2.5	

(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：13,460円 期末：15,841円 騰落率：17.7%

【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、原油価格が上昇したことや、米国新政権の政策への期待から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。

◆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、中国株や中国・人民元の下落、原油価格の下落、欧州の一部大手銀行に対する信用不安など

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	5円 (5)
(先物)	(1)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	6 (6)
(投資信託証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	21 (19)
(その他)	(2)
合 計	32

(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

(2016年1月13日から2017年1月10日まで)

	買		付		売		付	
	株数	金額	株数	金額	株数	金額	株数	金額
外	アメリカ	百株 5,623.95 (△ 44.68)	千アメリカ・ドル 34,844 (△ 537)	百株	千アメリカ・ドル 2,590	百株	千アメリカ・ドル 2,590	
	カナダ	百株 912.5 (3.95)	千カナダ・ドル 3,559 ()	百株	千カナダ・ドル 753	百株	千カナダ・ドル 753	
	オーストラリア	百株 1,703.5 (△ 10.83)	千オーストラリア・ドル 2,365 (△ 18)	百株	千オーストラリア・ドル 394	百株	千オーストラリア・ドル 394	
	香港	百株 1,911 (19.21)	千香港ドル 6,638 ()	百株	千香港ドル 1,556	百株	千香港ドル 1,556	
	シンガポール	百株 1,187 ()	千シンガポール・ドル 445 (△ 0)	百株	千シンガポール・ドル 70	百株	千シンガポール・ドル 70	
	ニュージーランド	百株 181 ()	千ニュージーランド・ドル 59 ()	百株	千ニュージーランド・ドル 21	百株	千ニュージーランド・ドル 21	
	イギリス	百株 5,342.5 (△ 68.45)	千イギリス・ポンド 2,954 (△ 85)	百株	千イギリス・ポンド 19	百株	千イギリス・ポンド 19	
	イスラエル	百株 42 ()	千イスラエル・シケル 275 ()	百株	千イスラエル・シケル 320	百株	千イスラエル・シケル 320	
	スイス	百株 361.8 ()	千スイス・フラン 2,302 (△ 18)	百株	千スイス・フラン 427	百株	千スイス・フラン 427	
	デンマーク	百株 91.16 ()	千デンマーク・クローネ 3,053 ()	百株	千デンマーク・クローネ 438	百株	千デンマーク・クローネ 438	
	ノルウェー	百株 107.5 ()	千ノルウェー・クローネ 1,518 (△ 1)	百株	千ノルウェー・クローネ 220	百株	千ノルウェー・クローネ 220	
	スウェーデン	百株 621 ()	千スウェーデン・クローネ 7,565 (△ 9)	百株	千スウェーデン・クローネ 1,874	百株	千スウェーデン・クローネ 1,874	
	ユーロ (アイルランド)	百株 1,317 ()	千ユーロ 107 ()	百株	千ユーロ -	百株	千ユーロ -	
	ユーロ (オランダ)	百株 339 (6.51)	千ユーロ 686 (△ 2)	百株	千ユーロ 46	百株	千ユーロ 46	
	ユーロ (ベルギー)	百株 35.5 (△ 1.5)	千ユーロ 268 ()	百株	千ユーロ 27	百株	千ユーロ 27	
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 73.6 ()	千ユーロ 96 (△ 0)	百株	千ユーロ -	百株	千ユーロ -	
	ユーロ (フランス)	百株 420.9 (2.64)	千ユーロ 1,753 ()	百株	千ユーロ 28	百株	千ユーロ 28	
	ユーロ (ドイツ)	百株 401.6 (2.95)	千ユーロ 1,763 (△ 2)	百株	千ユーロ 31	百株	千ユーロ 31	
	ユーロ (ポルトガル)	百株 18 ()	千ユーロ 22 ()	百株	千ユーロ -	百株	千ユーロ -	
ユーロ (スペイン)	百株 857 (138.05)	千ユーロ 604 ()	百株	千ユーロ 15	百株	千ユーロ 15		
ユーロ (イタリア)	百株 728.5 (18.47)	千ユーロ 290 (△ 0)	百株	千ユーロ 16	百株	千ユーロ 16		
ユーロ (フィンランド)	百株 194.5 ()	千ユーロ 198 ()	百株	千ユーロ 17	百株	千ユーロ 17		
ユーロ (オーストリア)	百株 12.5 ()	千ユーロ 40 (△ 0)	百株	千ユーロ -	百株	千ユーロ -		
ユーロ (その他)	百株 - (5)	千ユーロ - (15)	百株	千ユーロ -	百株	千ユーロ -		
ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 4,398.1 (172.12)	千ユーロ 5,834 ()	百株	千ユーロ 183	百株	千ユーロ 183		

(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1月13日から2017年1月10日まで)

		買		付		売		付	
		口数	金額	口数	金額	口数	金額	口数	金額
外	アメリカ	千口 24.02 (0.83)	千アメリカ・ドル 1,215 (8)	千口 0.49 (-)	千アメリカ・ドル 35 (-)	千口 0.49 (-)	千アメリカ・ドル 35 (-)	千口 0.49 (-)	千アメリカ・ドル 35 (-)
	オーストラリア	千口 40.3 ()	千オーストラリア・ドル 194 ()	千口 4.9 ()	千オーストラリア・ドル 25 ()	千口 4.9 ()	千オーストラリア・ドル 25 ()	千口 4.9 ()	千オーストラリア・ドル 25 ()
	香港	千口 6.5 ()	千香港ドル 349 ()	千口 - ()	千香港ドル - ()	千口 - ()	千香港ドル - ()	千口 - ()	千香港ドル - ()
	シンガポール	千口 12 ()	千シンガポール・ドル 29 (△ 0)	千口 - ()	千シンガポール・ドル - ()	千口 - ()	千シンガポール・ドル - ()	千口 - ()	千シンガポール・ドル - ()
	イギリス	千口 2.15 ()	千イギリス・ポンド 21 ()	千口 - ()	千イギリス・ポンド - ()	千口 - ()	千イギリス・ポンド - ()	千口 - ()	千イギリス・ポンド - ()
	ユーロ (フランス)	千口 0.76 ()	千ユーロ 82 ()	千口 - ()	千ユーロ - ()	千口 - ()	千ユーロ - ()	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。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2016年1月13日から2017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	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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	4,458	4,266	-	-	-	-	-	-

(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1月13日から2017年1月10日まで)

銘	当				期			
	買	付	株数	平均単価	売	付	株数	平均単価
APPLE INC (アメリカ)	9.6	118,004	12,292	円	1.7	13,489	7,934	円
MICROSOFT CORP (アメリカ)	13	84,012	6,462	円	0.85	12,087	14,220	円
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	7.85	75,566	9,626	円	2	11,173	5,586	円
AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.69	58,912	85,380	円	1.5	10,273	6,849	円
GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)	17.65	58,510	3,315	円	3	10,012	3,337	円
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	4.6	58,233	12,659	円	2	9,409	4,704	円
NESTLE SA-REG (スイス)	7.2	57,241	7,950	円	0.36	9,356	25,990	円
FACEBOOK INC-A (アメリカ)	4.25	57,091	13,433	円	1.8	8,748	4,860	円
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	6.1	48,423	7,938	円	0.75	7,988	10,651	円
AT&T INC (アメリカ)	11.2	48,104	4,295	円	1.2	7,929	6,607	円

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■損益の状況

当期 自2016年1月13日 至2017年1月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	144,575,633円
受取配当金	143,741,742
受取利息	90,123
その他収益金	815,203
支払利息	△ 71,435
(B) 有価証券売買損益	939,871,022
売買益	2,765,576,221
売買損	△1,825,705,199
(C) 先物取引等損益	97,647,286
取引益	107,163,411
取引損	△ 9,516,125
(D) その他費用	△ 9,089,255
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	1,173,004,686
(F) 前期繰越損益金	1,366,965,369
(G) 解約差損益金	△ 366,270,176
(H) 追加信託差損益金	2,362,275,198
(I) 合計(E + F + G + H)	4,535,975,077
次期繰越損益金(I)	4,535,975,077

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

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

《お知らせ》

■投資信託証券への投資制限の変更

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

ダイワファンドラップ 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1期

(決算日 2017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1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

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

<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
	円	円	%	(ベンチマーク)	%				
1期末(2017年6月15日)	12,232	0	22.3	12,081	20.8	96.0	1.4	2.6	1,719

(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。

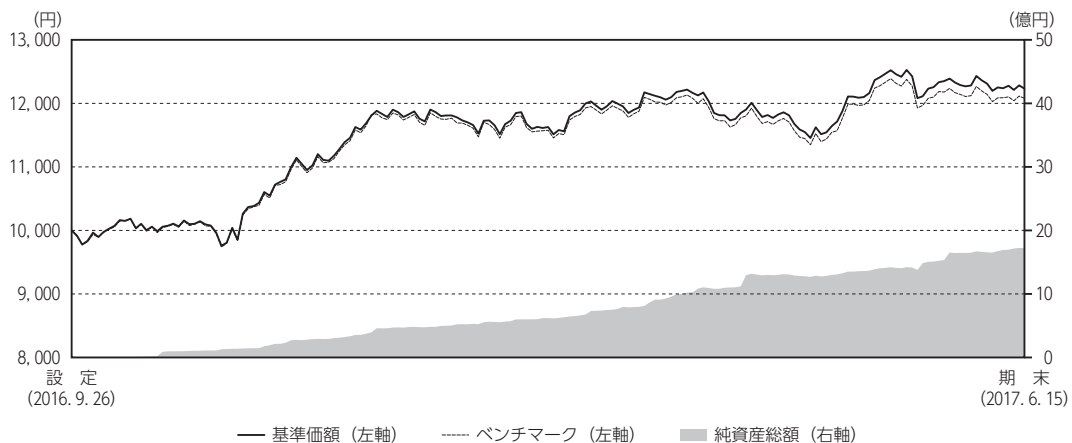
(注3) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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、設定時を10,000として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

設定時：10,000円

期末：12,232円

騰落率：22.3%

■基準価額の主な変動要因

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
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(設定) 2016年 9月26日	10,000	—	(9/23) 10,000	—	%	%	%
9月末	9,897	△ 1.0	9,894	△ 1.1	95.8	1.4	2.7
10月末	10,096	1.0	10,073	0.7	95.9	1.3	2.6
11月末	11,026	10.3	10,984	9.8	96.0	1.4	2.5
12月末	11,718	17.2	11,653	16.5	96.3	0.9	2.5
2017年 1月末	11,677	16.8	11,620	16.2	96.2	1.4	2.5
2月末	11,899	19.0	11,836	18.4	95.9	1.6	2.6
3月末	12,010	20.1	11,924	19.2	96.1	1.2	2.6
4月末	12,090	20.9	11,969	19.7	96.3	1.0	2.6
5月末	12,269	22.7	12,108	21.1	95.9	1.6	2.5
(期末) 2017年 6月15日	12,232	22.3	12,081	20.8	96.0	1.4	2.6

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2016. 9. 26 ~ 2017. 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、設定時より、中国の貿易統計が予想を下回ったことや、米国大統領選挙を控えてリスク回避姿勢が広がったことなどを背景に、軟調な推移となりました。2016年11月に入ると、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことによる新政権の政策への期待から、市況は米国市場を中心に上昇に転じました。2017年1月以降は、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、市況の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などを受けて上昇し、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、設定時より、米国の利上げ観測などを受けて米ドル高が進行しました。その後、2016年11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことや12月の米国の利上げにより金利が上昇し、大きく円安が進みました。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月には欧州の政治リスクが後退したことから円安に転じましたが、5月はトランプ大統領のロシアとの不透明な関係をめぐる疑惑への懸念が高まったことなどから、主に米ドルが下落しました。

ポートフォリオについて

(2016. 9. 26 ~ 2017. 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（MSCIコクサイ指数（円ベース））との連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

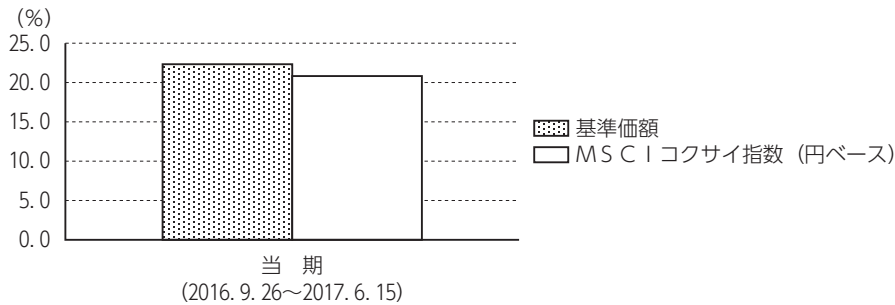
ベンチマークとの差異について

当期のベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ベース））の騰落率は20.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は22.3%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ため、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	
	2016年9月26日 ～2017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)	2,232

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国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。

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2016.9.26~2017.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	36円	0.315%	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11,488円です。
(投信会社)	(25)	(0.222)	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)	(9)	(0.078)	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)	(0.015)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0.003	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.003)	
(先物)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.003	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権総口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.003)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	7	0.064	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権総口数
(保管費用)	(7)	(0.059)	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	44	0.385	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

■親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年9月26日から2017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
外国株式 インデックス マザーファンド	795,626	1,642,674	2,097	4,554

(注) 単位未満は切捨て。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	1	—	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2016年9月26日から2017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	7,373,682千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	77,808,856千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.09

(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。

■組入資産明細表

■親投資信託残高

種類	当期末	
	口数 千口	評価額 千円
外国株式インデックス マザーファンド	793,528	1,719,734

(注) 単位未満は切捨て。

■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。

■投資信託財産の構成

2017年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国株式インデックス マザーファンド	1,719,734 千円	99.9 %
コール・ローン等、その他	1,500	0.1
投資信託財産総額	1,721,235	100.0

- (注1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.72円、1カナダ・ドル=82.89円、1オーストラリア・ドル=83.28円、1香港ドル=14.07円、1シンガポール・ドル=79.70円、1ニュージーランド・ドル=79.51円、1イギリス・ポンド=139.91円、1イスラエル・シェケル=31.15円、1スイス・フラン=112.97円、1デンマーク・クローネ=16.56円、1ノルウェー・クローネ=13.03円、1スウェーデン・クローネ=12.61円、1ユーロ=123.11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(86,076,984千円)の投資信託財産総額(86,394,814千円)に対する比率は、99.6%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	74,609,856
(c) 収益調整金	239,248,409
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	313,858,265
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	313,858,265
(h) 受益権総口数	1,405,993,525口

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,721,235,043円
コール・ローン等	1,500,739
外国株式インデックス マザーファンド (評価額)	1,719,734,304
(B) 負債	1,383,947
未払信託報酬	1,366,785
その他未払費用	17,162
(C) 純資産総額 (A - B)	1,719,851,096
元本	1,405,993,525
次期繰越損益金	313,857,571
(D) 受益権総口数	1,405,993,525口
1万口当り基準価額 (C/D)	12,232円

- * 設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は1,475,674,063円、同解約元本額は70,680,538円です。
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は12,232円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月26日 至2017年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 449円
受取利息	8
支払利息	△ 457
(B) 有価証券売買損益	76,979,375
売買益	81,614,104
売買損	△ 4,634,729
(C) 信託報酬等	△ 2,369,519
(D) 当期損益金 (A + B + C)	74,609,407
(E) 追加信託差損益金	239,248,164
(配当等相当額)	(△ 245)
(売買損益相当額)	(239,248,409)
(F) 合計 (D + E)	313,857,571
次期繰越損益金 (F)	313,857,571
追加信託差損益金	239,248,164
(配当等相当額)	(△ 245)
(売買損益相当額)	(239,248,409)
分配準備積立金	74,609,856
繰越損益金	△ 449

- (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。

<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（2016年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017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

(2016年9月26日から2017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
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR (イスラエル)	20.9	100,444	4,805	YAHOO! INC (アメリカ)	21.7	122,988	5,667
ENBRIDGE INC (カナダ)	17	78,954	4,644	SYNGENTA AG-REG (スイス)	2.162	107,998	49,952
UNICREDIT SPA (イタリア)	41.4	50,117	1,210	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD (イスラエル)	20.6	96,915	4,704
APPLE INC (アメリカ)	3.5	47,356	13,530	APPLE INC (アメリカ)	6.1	84,376	13,832
MICROSOFT CORP (アメリカ)	6.4	42,941	6,709	ENBRIDGE INC (カナダ)	15.74	73,158	4,647
FACEBOOK INC-A (アメリカ)	2.75	40,704	14,801	MICROSOFT CORP (アメリカ)	6.9	49,866	7,227
AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.42	38,651	92,028	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	3.8	36,056	9,488
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	4	36,828	9,207	GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)	9.6	34,386	3,581
ADVANCED MICRO DEVICES (アメリカ)	19	31,898	1,678	EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	3.3	32,723	9,916
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED (ドイツ)	16.6	30,907	1,861	JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	2.45	32,058	13,085

(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、2017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（39,756,964千円）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	株数	2017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	27	202	22,265	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	21	281	30,847	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	13.5	204	22,399	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	188	549	60,293	金融
ABBOTT LABORATORIES	394.16	1,877	206,029	ヘルスケア
ARCONIC INC	103.33	277	30,497	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	37.5	311	34,138	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	101	658	72,297	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	69.5	527	57,908	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	71.79	615	67,527	情報技術
QORVO INC	29	209	22,950	情報技術
AFLAC INC	93	726	79,692	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	27.5	248	27,297	一般消費財・サービス
ADOBE SYSTEMS INC	113.5	1,569	172,165	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	55	150	16,516	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	25	132	14,562	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	68	120	13,243	金融
GARMIN LTD	26	134	14,754	一般消費財・サービス
AETNA INC	79.29	1,190	130,608	ヘルスケア
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	46.5	676	74,264	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	165	2,214	243,025	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	37.51	222	24,380	情報技術
WR BERKLEY CORP	21	145	15,997	金融
AUTOZONE INC	6.7	407	44,723	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	52.71	396	43,531	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	209	641	70,330	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	26.5	233	25,604	公益事業
CELANESE CORP-SERIES A	33	297	32,601	素材
DR HORTON INC	79.66	273	30,040	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	21	72	7,965	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	52	331	36,360	ヘルスケア
AUTODESK INC	45.5	483	53,017	情報技術
MOODY'S CORP	38.5	462	50,694	金融
DEVON ENERGY CORP	109	350	38,497	エネルギー
ALBEMARLE CORP	26	284	31,171	素材
ATMOS ENERGY CORP	23	195	21,472	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	50	207	22,805	公益事業
CITIGROUP INC	646.23	4,182	458,892	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	103	1,042	114,424	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	111	798	87,639	公益事業
ALLEGHANY CORP	3.5	209	23,004	金融
DOMINO'S PIZZA INC	11	231	25,412	一般消費財・サービス
HESS CORP	65	294	32,299	エネルギー
DAVITA INC	38	250	27,505	ヘルスケア
DANAHER CORP	142	1,199	131,590	ヘルスケア

銘柄	2017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		
FORTIVE CORP	72	453	49,729	資本財・サービス
AVNET INC	28	107	11,781	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	135	873	95,790	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	40	90	9,962	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	40.28	84	9,320	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	129	542	59,517	生活必需品
BUNGE LTD	31	241	26,489	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	82.25	647	71,031	情報技術
APPLE INC	1,212	17,593	1,930,346	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	91	551	60,536	金融
BOEING CO/THE	132.5	2,549	279,680	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	34.65	253	27,772	金融
BECTON DICKINSON AND CO	48.87	940	103,229	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	40	92	10,155	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	33	181	19,964	情報技術
CDK GLOBAL INC	29	177	19,517	情報技術
NISOURCE INC	73	189	20,760	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	33.5	227	24,935	資本財・サービス
CR BARD INC	16.8	528	57,997	ヘルスケア
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	242.71	1,207	132,538	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	927.04	4,328	474,906	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	278.5	4,774	523,900	金融
ANSYS INC	19	233	25,587	情報技術
H&R BLOCK INC	51	148	16,300	一般消費財・サービス
BB&T CORP	183.5	817	89,655	金融
BAKER HUGHES INC	91.73	514	56,472	エネルギー
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	380.5	2,074	227,612	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	814.7	7,095	778,487	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	56	410	45,000	金融
CIGNA CORP	59	991	108,825	ヘルスケア
LKQ CORP	68	221	24,255	一般消費財・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	10	140	15,432	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	50	246	27,067	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	64	219	24,113	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	36.6	467	51,333	金融
DOLLAR GENERAL CORP	65	491	53,959	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	38	388	42,594	情報技術
CATERPILLAR INC	132	1,382	151,651	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	64	305	33,523	公益事業
MOSAIC CO/THE	75.5	171	18,837	素材
DELTA AIR LINES INC	44	228	25,060	資本財・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	41	368	40,477	生活必需品
CORNING INC	216	631	69,321	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,141	3,605	395,602	情報技術
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	197	1,631	179,014	素材
MORGAN STANLEY	318	1,428	156,695	金融
WABCO HOLDINGS INC	12.5	152	16,678	資本財・サービス
DOW CHEMICAL CO/THE	257	1,658	181,961	素材
MSCI INC	20	210	23,126	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	9	167	18,406	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	13	173	19,000	資本財・サービス
COTY INC-CL A	111.39	213	23,477	生活必需品
BROADCOM LTD	91.52	2,201	241,540	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	10.5	136	14,995	ヘルスケア
DICK'S SPORTING GOODS INC	20	81	8,911	一般消費財・サービス
ACUITY BRANDS INC	10	180	19,817	資本財・サービス
ARAMARK	53.5	216	23,726	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	49	163	17,929	素材
DTE ENERGY COMPANY	41.5	458	50,310	公益事業
CENTENE CORP	40	313	34,390	ヘルスケア
CBOE HOLDINGS INC	24	216	23,699	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	116	424	46,557	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	40.5	234	25,759	金融
GARTNER INC	19	231	25,374	情報技術
SPLUNK INC	32	184	20,223	情報技術
AGCO CORP	14.5	97	10,689	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC	143	1,143	125,503	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	93	471	51,785	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	34	193	21,211	資本財・サービス
DEERE & CO	60.5	764	83,924	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	36	325	35,707	情報技術
TIME WARNER INC	176.33	1,748	191,805	一般消費財・サービス
VMWARE INC-CLASS A	14.5	127	13,992	情報技術
NASDAQ INC	27	191	21,048	金融
VAIL RESORTS INC	9.5	194	21,295	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	34	201	22,054	金融
TARGA RESOURCES CORP	41.5	180	19,811	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	15	191	21,033	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	18	182	19,978	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	70	585	64,200	公益事業
MEDNAX INC	22	125	13,737	ヘルスケア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	24	242	26,580	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	2017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		
TELEFLEX INC	10	201	22,101	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	21	188	20,707	資本財・サービス
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	17.5	135	14,884	資本財・サービス
IDEX CORP	18	201	22,115	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	191.5	1,453	159,434	生活必需品
ROLLINS INC	22	95	10,435	資本財・サービス
AMETEK INC	52.25	321	35,280	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	58	308	33,842	生活必需品
LYONDELLBASELL INDU-CL A	80	647	71,037	素材
COSTCO WHOLESale CORP	99.5	1,807	198,331	生活必需品
SCANA CORP	31	215	23,628	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	12	195	21,494	金融
WR GRACE & CO	16	113	12,462	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6.5	298	32,784	一般消費財・サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP	76	196	21,505	金融
UGI CORP	39	198	21,823	公益事業
CUMMINS INC	37	590	64,747	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	136	794	87,218	情報技術
SABRE CORP	46	105	11,522	情報技術
CDW CORP/DE	32.5	200	21,987	情報技術
SIGNATURE BANK	13	196	21,565	金融
COSTAR GROUP INC	7.5	189	20,821	情報技術
SVB FINANCIAL GROUP	12	219	24,036	金融
AMERCO	1.7	59	6,542	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	9	238	26,168	情報技術
HANESBRANDS INC	85	195	21,403	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	18	187	20,517	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	45.66	302	33,190	一般消費財・サービス
COMMScope HOLDING CO INC	46	171	18,770	情報技術
DEXCOM INC	19	141	15,566	ヘルスケア
DIAMONDBACK ENERGY INC	20.5	183	20,108	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	22.5	143	15,784	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	17	245	26,915	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	12	324	35,626	資本財・サービス
NIelsen HOLDINGS PLC	80	309	33,934	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	428.81	813	89,204	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	68	580	63,679	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	105.5	243	26,739	エネルギー
T-MOBILE US INC	64.5	408	44,775	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	25	114	12,551	情報技術
COCA-COLA CO/THE	934.5	4,233	464,476	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	40	225	24,722	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	25	121	13,325	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	82	362	39,766	金融
CSX CORP	214	1,138	124,867	資本財・サービス
FLUOR CORP	33	152	16,713	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	23.5	331	36,384	ヘルスケア
EXPEDIA INC	28.75	423	46,430	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	20	222	24,408	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	91.9	8,973	984,600	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	50	139	15,300	エネルギー
FLOWSERVE CORP	29	137	15,104	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49	563	61,832	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	943.05	7,739	849,190	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	31	111	12,241	情報技術
AES CORP	156	185	20,385	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	18	303	33,252	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	9	227	24,922	金融
EOG RESOURCES INC	132.5	1,178	129,285	エネルギー
EQT CORP	40.5	232	25,559	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	39	192	21,074	情報技術
AMERISOURCEBERGEN CORP	38	356	39,150	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	72.9	432	47,495	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	853.23	957	105,037	一般消費財・サービス
MACY'S INC	68.98	156	17,225	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	34.4	90	9,915	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	56.87	165	18,151	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	51.2	130	14,280	一般消費財・サービス
MOBILEYE NV	39	244	26,816	情報技術
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	3	33	3,640	ヘルスケア
AERCap HOLDINGS NV	38	177	19,483	資本財・サービス
FORTINET INC	35	132	14,535	情報技術
MARKEL CORP	3.2	317	34,830	金融
NEXTERA ENERGY INC	107	1,510	165,710	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	297.08	359	39,408	素材
US BANCORP	387.5	2,047	224,657	金融
UNITED RENTALS INC	19	199	21,849	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	14.5	188	20,647	情報技術
FASTENAL CO	65	280	30,802	資本財・サービス
FISERV INC	49.5	616	67,682	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	2,015	5,781	634,295	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	36.5	190	20,892	一般消費財・サービス

銘柄	2017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		
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	61.5	214	23,536	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	311	1,076	118,099	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	27.5	106	11,637	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	59	1,187	130,298	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	81.5	1,846	202,549	金融
ALPHABET INC-CL A	67.4	6,523	715,796	情報技術
ALPHABET INC-CL C	70.57	6,709	736,167	情報技術
GENERAL MILLS INC	136	799	87,666	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	99.68	294	32,362	公益事業
GENUINE PARTS CO	35	329	36,197	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	82.34	388	42,633	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	175	447	49,116	金融
HARRIS CORP	27.5	300	33,000	情報技術
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	30	148	16,257	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	198.5	889	97,637	エネルギー
HOME DEPOT INC	275.5	4,318	473,851	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	14	143	15,718	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	246	329	36,195	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	11	216	23,748	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	33	377	41,417	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	40	213	23,409	一般消費財・サービス
HUMANA INC	34	787	86,438	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	76	830	91,117	情報技術
HELMERICH & PAYNE	26	139	15,356	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	18	331	36,343	ヘルスケア
HP INC	389	676	74,265	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	377	631	69,244	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	45	178	19,552	一般消費財・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	39	98	10,796	エネルギー
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	21	83	9,156	一般消費財・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	28	263	28,955	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	138.53	1,266	139,014	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	205.5	3,160	346,802	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	88	491	53,963	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	36	235	25,804	資本財・サービス
ZOETIS INC	107	665	73,058	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	57.79	512	56,235	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	47	220	24,211	エネルギー
ALLEGION PLC	22	175	19,250	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	31	163	17,955	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	137.23	387	42,550	一般消費財・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	41.05	407	44,657	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	76	218	23,940	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	27.2	346	38,044	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	619.5	8,225	902,458	ヘルスケア
ABBVIE INC	371.79	2,621	287,670	ヘルスケア
HOLOGIC INC	57.5	257	28,207	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	81.5	1,062	116,579	生活必需品
KROGER CO	205	620	68,107	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	36.5	359	39,467	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	60	1,681	184,527	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	21	307	33,769	情報技術
L BRANDS INC	56	295	32,466	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	197.5	1,591	174,571	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	224	1,827	200,550	ヘルスケア
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	69	442	48,596	電気通信サービス
LAM RESEARCH CORP	37	565	62,011	情報技術
RANGE RESOURCES CORP	43	99	10,936	エネルギー
JONES LANG LASALLE INC	10	120	13,191	不動産
LOEWS CORP	65	309	33,990	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	51.49	351	38,557	金融
MCDONALD'S CORP	188.5	2,840	311,639	一般消費財・サービス
3M CO	137	2,877	315,679	資本財・サービス
FACEBOOK INC-A	532.5	8,000	877,849	情報技術
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	49.54	307	33,792	情報技術
MANPOWERGROUP INC	15	158	17,399	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	59.5	877	96,234	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	14	323	35,471	素材
CONCHO RESOURCES INC	32.5	395	43,343	エネルギー
ENVISION HEALTHCARE CORP	26.36	152	16,699	ヘルスケア
FIRST DATA CORP- CLASS A	72	130	14,306	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	38	124	13,625	電気通信サービス
PHILLIPS 66	106.5	839	92,055	エネルギー
MURPHY OIL CORP	36	89	9,831	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	100	283	31,138	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	107.5	347	38,156	一般消費財・サービス
MATTEL INC	78	172	18,956	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	65.38	488	53,650	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	26.5	279	30,648	生活必需品
MYLAN NV	104.5	395	43,432	ヘルスケア
METLIFE INC	213.5	1,138	124,879	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	105	184	20,207	情報技術

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2017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		
MOTOROLA SOLUTIONS INC	33.78	286	31,455	情報技術
MONSANTO CO	100.56	1,186	130,139	素材
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	349	38,299	ヘルスケア
ROCKWELL AUTOMATION INC	29.5	471	51,742	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	629.71	3,990	437,834	ヘルスケア
MASCO CORP	74	284	31,194	資本財・サービス
M & T BANK CORP	31.69	515	56,519	金融
MARSH & MCLENNAN COS	117.5	935	102,595	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	75.22	781	85,758	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	27	266	29,203	情報技術
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	39.5	136	14,978	一般消費財・サービス
VANTIV INC - CL A	35.5	220	24,227	情報技術
NETAPP INC	61.5	234	25,709	情報技術
NIKE INC -CL B	305.5	1,669	183,217	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	65.5	774	85,011	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	48.5	399	43,795	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	30	236	25,983	金融
ALLY FINANCIAL INC	102	203	22,371	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	38.3	994	109,116	資本財・サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	62	532	58,455	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	120	404	44,397	素材
MCKESSON CORP	51.5	841	92,313	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	64	300	33,017	情報技術
XYLEM INC	42	225	24,727	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	352.5	4,221	463,148	生活必需品
NUCOR CORP	71.5	422	46,371	素材
WESTERN UNION CO	113.46	218	23,939	情報技術
NEWELL BRANDS INC	100.92	552	60,657	一般消費財・サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	174	1,046	114,776	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	23.5	206	22,661	一般消費財・サービス
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	6	79	8,683	生活必需品
PAYCHEX INC	75.5	453	49,777	情報技術
PATTERSON COS INC	19	88	9,741	ヘルスケア
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21.2	496	54,506	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	443.5	3,359	368,605	生活必需品
P G & E CORP	115	786	86,242	公益事業
PFIZER INC	1,376.63	4,500	493,762	ヘルスケア
ALKERMES PLC	36	214	23,490	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	115	544	59,770	公益事業
STRYKER CORP	76	1,078	118,318	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	30.5	479	52,569	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	39	642	70,544	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	14	123	13,543	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	581.17	5,139	563,946	生活必需品
EXELON CORP	212.22	778	85,431	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	51	601	66,029	ヘルスケア
NVR INC	0.9	221	24,271	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	282.5	1,283	140,783	エネルギー
PEPSICO INC	326	3,826	419,817	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	99	1,070	117,421	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	40.5	329	36,135	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	142	1,806	198,258	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	19.5	126	13,919	金融
PENTAIR PLC	40.05	266	29,222	資本財・サービス
QUALCOMM INC	333.5	1,901	208,608	情報技術
INVESCO LTD	91.5	317	34,816	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	17	222	24,358	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	66	431	47,330	金融
RAYTHEON COMPANY	67	1,088	119,428	資本財・サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	18	120	13,184	一般消費財・サービス
RED HAT INC	42	373	40,976	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	17.7	844	92,604	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	53.5	343	37,656	資本財・サービス
PRICELINE GROUP INC/THE	11.2	2,051	225,079	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	90	549	60,335	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	21	220	24,181	素材
RESMED INC	32.5	244	26,869	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	31	332	36,472	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	28	134	14,703	資本財・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	194.78	1,281	140,601	生活必需品
RALPH LAUREN CORP	13	91	10,068	一般消費財・サービス
AUTONATION INC	17	71	7,863	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	36.13	384	42,218	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	274.35	397	43,647	金融
CHEVRON CORP	429.68	4,580	502,560	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	75	606	66,556	公益事業
TESLA INC	29	1,103	121,121	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	139	404	44,365	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	34.72	491	53,934	資本財・サービス
SYNOPTIS INC	34	252	27,732	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	49.05	1,659	182,081	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	71	251	27,631	不動産

銘柄	2017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		
TWITTER INC	130	217	23,905	情報技術
NAVIENT CORP	71	111	12,191	金融
SOUTHERN CO/THE	223.5	1,144	125,603	公益事業
SYSCO CORP	118.5	656	72,056	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	65.23	834	91,581	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	32	173	18,987	金融
STERICYCLE INC	19.5	152	16,739	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	57	197	21,657	素材
SCHLUMBERGER LTD	316.52	2,158	236,779	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	39	166	18,224	資本財・サービス
AT&T INC	1,394.91	5,401	592,607	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	34	202	22,207	資本財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	17.8	627	68,880	素材
SEMPRA ENERGY	54	617	67,786	公益事業
TIFFANY & CO	28	256	28,110	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	65	268	29,440	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	227.5	1,823	200,089	情報技術
SALESFORCE.COM INC	147	1,281	140,595	情報技術
SIGNET JEWELERS LTD	13	77	8,553	一般消費財・サービス
WESTROCK CO	59.3	336	36,956	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	215.84	903	99,132	資本財・サービス
TESORO CORP	26.5	244	26,787	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	186	2,042	224,078	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	190	240	26,350	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	119	634	69,657	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	177	2,124	233,064	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	157	1,717	188,435	資本財・サービス
UNUM GROUP	54	254	27,906	金融
SPRINT CORP	177.65	144	15,866	電気通信サービス
ANTERO RESOURCES CORP	34	74	8,162	エネルギー
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	34.94	301	33,103	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	45	168	18,446	金融
AMEREN CORPORATION	55	310	34,041	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	218.76	3,989	437,706	ヘルスケア
VERISIGN INC	22	201	22,125	情報技術
VALERO ENERGY CORP	103.92	672	73,828	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	13.1	395	43,437	一般消費財・サービス
FNF GROUP	57.38	246	27,008	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	20	233	25,650	ヘルスケア
ANTHEM INC	60.5	1,142	125,306	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	349.5	3,709	407,016	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	1,084.72	5,914	648,991	金融
FOOT LOCKER INC	32	172	18,878	一般消費財・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	100	734	80,556	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	187	538	59,070	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	31	173	19,088	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	17	334	36,659	一般消費財・サービス
WAL-MART STORES INC	351.5	2,808	308,146	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	46	577	63,391	ヘルスケア
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	221	91	10,062	エネルギー
WYNN RESORTS LTD	18	240	26,363	一般消費財・サービス
XEROX CORP	192.44	133	14,632	情報技術
WABTEC CORP	19	167	18,351	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	149	1,090	119,620	一般消費財・サービス
WATERS CORP	18	332	36,530	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	18	139	15,317	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	85.57	1,994	218,795	ヘルスケア
WHOLE FOODS MARKET INC	72	255	28,004	生活必需品
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	211	1,748	191,874	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	30.33	448	49,244	金融
WESTERN DIGITAL CORP	64.5	566	62,135	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	70.3	448	49,180	公益事業
WESTAR ENERGY INC	32	170	18,703	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	117.5	520	57,073	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	425.5	4,055	445,009	情報技術
PPL CORP	154	605	66,387	公益事業
PULTEGROUP INC	67	162	17,848	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	59.5	663	72,790	素材
NORTHERN TRUST CORP	49	457	50,192	金融
NVIDIA CORP	122	1,850	203,089	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	110.93	1,375	150,886	金融
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	95.5	231	25,409	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	47	152	16,764	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	65	406	44,580	生活必需品
NETFLIX INC	96.5	1,468	161,149	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	89.5	1,562	171,426	ヘルスケア
TORCHMARK CORP	26.75	205	22,581	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	34.5	348	38,186	金融
TEXTRON INC	63.5	300	33,024	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	239.5	661	72,553	一般消費財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	103	279	30,660	一般消費財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	83.37	113	12,422	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	2017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	
OGE ENERGY CORP	47	167	18,378	公益事業
OMNICOM GROUP	55	453	49,731	一般消費財・サービス
ORACLE CORP	700.83	3,140	344,566	情報技術
MASTERCARD INC - A	220	2,695	295,695	情報技術
ONEOK INC	49	243	26,768	エネルギー
CENTURYLINK INC	127.95	349	38,339	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	23	526	57,749	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	79	577	63,310	一般消費財・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	11.5	279	30,700	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	43.5	383	42,058	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	96	284	31,209	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	2,306.01	5,479	601,164	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	38.5	353	38,829	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	141	15,575	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	178	1,438	157,881	金融
ANALOG DEVICES INC	82.99	671	73,701	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	175	205	22,599	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	60	244	26,879	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	234.22	1,504	165,113	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	127	600	65,882	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	41.5	425	46,658	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	38.5	429	47,159	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	45	135	14,841	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	25	105	11,561	ヘルスケア
AVERY DENNISON CORP	21	179	19,688	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	137.5	913	100,279	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	145.5	872	95,769	資本財・サービス
AON PLC	60	810	88,879	金融
AMGEN INC	169.5	2,798	307,045	ヘルスケア
CORE LABORATORIES N. V.	10	104	11,497	エネルギー
COACH INC	64	296	32,505	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	101.36	763	83,787	資本財・サービス
CELGENE CORP	176.5	2,136	234,400	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	40.2	723	79,349	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	245	1,077	118,224	情報技術
CIT GROUP INC	45	211	23,220	金融
CIMAREX ENERGY CO	21	204	22,467	エネルギー
CME GROUP INC	78	993	108,962	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	88.44	289	31,798	エネルギー
ECOLAB INC	59	789	86,666	素材
EQUIFAX INC	27.5	387	42,546	資本財・サービス
GAP INC/THE	58	134	14,795	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	300	1,949	213,921	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	40.98	384	42,148	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	68.5	237	26,094	生活必需品
STATE STREET CORP	87.93	780	85,661	金融
STAPLES INC	156	140	15,370	一般消費財・サービス
SUNTRUST BANKS INC	111.98	631	69,332	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	269	1,137	124,847	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	109.5	634	69,659	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	46	262	28,763	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	31	179	19,673	素材
CARDINAL HEALTH INC	71.5	540	59,315	ヘルスケア
FEDEX CORP	57	1,190	130,646	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	109.54	877	96,257	金融
FMC CORP	29.5	223	24,540	素材
FLEX LTD	122	203	22,314	情報技術
CERNER CORP	70	461	50,652	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	18	245	26,960	素材
CITRIX SYSTEMS INC	36.5	291	32,026	情報技術
INTEL CORP	1,080	3,837	421,021	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	88	215	23,674	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	86.5	448	49,209	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	72	1,056	115,922	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	385	198	21,796	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC	33.5	578	63,437	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	44	198	21,796	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	8.7	788	86,467	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	31	344	37,785	情報技術
SNAP-ON INC	13	204	22,396	資本財・サービス
CARMAX INC	42.5	262	28,831	一般消費財・サービス
COMERICA INC	40	297	32,591	金融
INGREDION INC	16	193	21,247	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	156.78	1,353	148,486	公益事業
TARGET CORP	119.5	691	75,863	一般消費財・サービス
DOVER CORP	35	286	31,412	資本財・サービス
VWV GRAINGER INC	13	230	25,249	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	29	158	17,369	資本財・サービス
CINTAS CORP	18.5	236	25,973	資本財・サービス
CA INC	71.05	225	24,735	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	95	370	40,609	生活必需品
CLOROX COMPANY	29.5	410	45,026	生活必需品

銘柄	2017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	39.5	313	34,420	公益事業
MICROSOFT CORP	1,676.5	11,780	1,292,585	情報技術
INCYTE CORP	38.5	462	50,728	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	242.24	1,957	214,754	生活必需品
MEDTRONIC PLC	317.38	2,781	305,223	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	241	748	82,130	情報技術
BLACKROCK INC	27.5	1,159	127,176	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	91	258	28,326	公益事業
HASBRO INC	26	284	31,183	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	61	448	49,186	生活必需品
KEYCORP	245	460	50,537	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	24	242	26,588	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	352.11	1,610	176,671	生活必需品
KOHL'S CORP	39	146	16,115	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	11	262	28,844	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	111	151	16,612	金融
APACHE CORP	87.6	418	45,865	エネルギー
CHUBB LTD	105.99	1,554	170,589	金融
ARROW ELECTRONICS INC	20	153	16,872	情報技術
ALLSTATE CORP	83.5	741	81,373	金融
EBAY INC	242	834	91,605	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC	249.5	1,294	142,076	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	32.5	269	29,554	素材
XILINX INC	56	363	39,864	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	139.1	877	96,334	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP-A	53	343	37,728	一般消費財・サービス
ZIONS BANCORPORATION	48	207	22,767	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	51.5	500	54,901	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	38	148	16,310	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	59	216	23,783	情報技術
LENNAR CORP-A	48	258	28,402	一般消費財・サービス
LEAR CORP	15.5	227	24,967	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	65	242	26,658	金融
PROGRESSIVE CORP	134	595	65,293	金融
PRAXAIR INC	64.5	871	95,673	素材
PACCAR INC	79.87	510	55,988	資本財・サービス
PVH CORP	19	202	22,187	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	49.8	1,261	138,442	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	20	321	35,248	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	331	1,994	218,884	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC	31.5	227	24,995	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	71.3	445	48,854	公益事業
INTUIT INC	56	785	86,137	情報技術
BORGWARNER INC	48	207	22,772	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	65	373	40,993	一般消費財・サービス
BALL CORP	75.84	313	34,349	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	310.47	863	94,768	ヘルスケア
BED BATH & BEYOND INC	36	130	14,271	一般消費財・サービス
XL GROUP LTD	61	261	28,652	金融
ELECTRONIC ARTS INC	68	748	82,085	情報技術
VULCAN MATERIALS CO	30.5	394	43,239	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	56.5	704	77,309	ヘルスケア
VF CORP	77.5	438	48,060	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	87.71	532	58,453	一般消費財・サービス
VIACOM INC-CLASS B	81.71	285	31,288	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	14	341	37,448	一般消費財・サービス
VCA INC	19	175	19,281	ヘルスケア
NUANCE COMMUNICATIONS INC	63	116	12,787	情報技術
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	22	225	24,737	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	80.5	521	57,199	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,085.4	4,459	489,341	一般消費財・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	52	215	23,591	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	48	317	34,885	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	265	205	22,533	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	70,414.74 601銘柄	488,092 53,553,464 <62.2%>	
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	67	256	21,287	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4.4	303	25,197	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	46.96	135	11,202	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	50.87	398	33,041	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	107	273	22,687	素材
INTACT FINANCIAL CORP	31.5	291	24,175	金融
BCE INC	34.3	203	16,865	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	40	376	31,213	素材
SUNCOR ENERGY INC	388.3	1,529	126,813	エネルギー
METRO INC	55	242	20,059	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	81	436	36,148	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	282	2,178	180,595	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	91.5	965	79,993	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2017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		
TORONTO-DOMINION BANK	432	2,795	231,716	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	67	228	18,965	金融
ROYAL BANK OF CANADA	345.5	3,225	267,368	金融
TOURMALINE OIL CORP	54	144	11,960	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	28	125	10,430	エネルギー
TRANSCANADA CORP	201.5	1,261	104,556	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	89	385	31,935	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	454	109	9,106	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	273	576	47,747	素材
CAE INC	58	127	10,533	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	67.04	395	32,791	金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	193	427	35,435	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	39	77	6,394	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	14	82	6,878	素材
VERESEN INC	80	147	12,194	エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B	34.5	233	19,343	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	97	96	7,967	金融
LINAMAR CORP	11	67	5,626	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	54	129	10,720	エネルギー
HYDRO ONE LTD	56	130	10,847	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	51.6	388	32,236	生活必需品
EMERA INC	13	62	5,207	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	28	114	9,469	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	86	537	44,560	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	52	323	26,801	素材
KINROSS GOLD CORP	295	161	13,351	素材
BANK OF MONTREAL	150	1,383	114,686	金融
POWER CORP OF CANADA	87	253	21,035	金融
METHANEX CORP	22	119	9,885	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	17	192	15,925	情報技術
TRISURA GROUP LTD-WI	1.22	2	222	金融
CAMECO CORP	92	112	9,341	エネルギー
TELUS CORP	54	240	19,954	電気通信サービス
POWER FINANCIAL CORP	62	204	16,969	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	134	300	24,902	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	16	235	19,531	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	208	70	5,844	素材
AGRIUM INC	31	383	31,752	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	258	963	79,896	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	5.4	308	25,557	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	89	533	44,255	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	11	132	10,942	生活必需品
BLACKBERRY LTD	119	166	13,779	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	142.5	645	53,531	金融
ENBRIDGE INC	380	1,892	156,892	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	207.5	1,050	87,116	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	458	1,098	91,074	金融
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	71	116	9,687	ヘルスケア
GOLDCORP INC	199.59	348	28,885	素材
ENCANA CORP	231	284	23,608	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	32	652	54,044	資本財・サービス
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	25	131	10,935	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	52	211	17,551	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	179.5	1,875	155,423	資本財・サービス
CGI GROUP INC - CLASS A	50	328	27,225	情報技術
HUSKY ENERGY INC	75.58	117	9,716	エネルギー
ONEX CORPORATION	20	198	16,428	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	95	286	23,749	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	39	100	8,291	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	34	178	14,773	資本財・サービス
IGM FINANCIAL INC	23	92	7,629	金融
OPEN TEXT CORP	62	263	21,826	情報技術
CI FINANCIAL CORP	54	145	12,040	金融
SAPUTO INC	58	243	20,148	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	158	172	14,288	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	98	601	49,852	生活必需品
YAMANA GOLD INC	233	77	6,412	素材
FORTIS INC	92	417	34,629	公益事業
CRESCENT POINT ENERGY CORP	133	148	12,314	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	196	214	17,789	エネルギー
DOLLARAMA INC	25	307	25,457	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	17	85	7,075	公益事業
ALTAGAS LTD	39	117	9,714	エネルギー
FIRST CAPITAL REALTY INC	26	54	4,487	不動産
KEYERA CORP	44	182	15,121	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	39	93	7,787	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	88	226	18,768	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	83	137	11,399	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額	9,569.26	38,648	3,203,593
	銘柄数 < 比率 >	91銘柄		< 3.7% >

銘柄	2017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	
(オーストラリア)				
HEALTHSCOPE LTD	375	82	6,839	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD	617	170	14,181	金融
BHP BILLITON LIMITED	747	1,769	147,375	素材
SOUTH32 LTD	1,272	352	29,343	素材
LENLELEASE GROUP	133	218	18,220	不動産
ALUMINA LTD	569	112	9,358	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	174	541	45,095	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	355	172	14,397	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	118	130	10,829	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	618	1,873	155,996	金融
WESTPAC BANKING CORP	777.98	2,436	202,922	金融
SANTOS LTD	428	136	11,370	エネルギー
AUSNET SERVICES	410	70	5,838	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	684	1,957	163,029	金融
RIO TINTO LTD	97	607	50,561	素材
ORIGIN ENERGY LTD	414	305	25,444	エネルギー
AMCOR LIMITED	267	436	36,310	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	468	259	21,592	資本財・サービス
OIL SEARCH LTD	329	226	18,823	エネルギー
SEEK LTD	75	124	10,362	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	171	231	19,239	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	176	384	32,011	素材
INCITEC PIVOT LTD	382	136	11,389	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	400	3,292	274,157	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	60	192	16,029	エネルギー
ORICA LTD	83	172	14,363	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	310	410	34,181	金融
CIMIC GROUP LTD	21	82	6,906	資本財・サービス
WOOLWORTHS LTD	300	788	65,682	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	137	124	10,359	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	205	93	7,819	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	81	104	8,715	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	102.54	55	4,654	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	986	429	35,801	電気通信サービス
AMP LTD	713	363	30,283	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	103	210	17,558	素材
MACQUARIE GROUP LTD	74.84	675	56,281	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	126	290	24,197	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	91	102	8,525	金融
CSL LTD	106	1,505	125,388	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	258.95	1,059	88,223	生活必需品
COCHLEAR LTD	14	216	18,067	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	134	168	14,072	素材
SUNCORP GROUP LTD	295	428	35,721	金融
BORAL LTD	277	197	16,470	素材
ASX LTD	47	244	20,377	金融
COMPUTERSHARE LTD	104	153	12,775	情報技術
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	53	4,453	一般消費財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	549	353	29,444	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	95	228	18,995	ヘルスケア
TRANSURBAN GROUP	478	610	50,834	資本財・サービス
CHALLENGER LTD	139	184	15,338	金融
SYDNEY AIRPORT	251	190	15,844	資本財・サービス
TATTS GROUP LTD	369	156	12,998	一般消費財・サービス
AGL ENERGY LTD	155	395	32,916	公益事業
BRAMBLES LTD	373	390	32,523	資本財・サービス
APA GROUP	267	257	21,435	公益事業
RAMSAY HEALTH CARE LTD	33	232	19,336	ヘルスケア
TPG TELECOM LTD	65	36	3,025	電気通信サービス
REA GROUP LTD	12	78	6,510	一般消費財・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	14	74	6,179	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 >	17,626.31 61銘柄	27,341 <2.6%>	2,276,986
(香港)		百株	千香港ドル	千円
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	330	2,311	32,524	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	550	2,659	37,415	一般消費財・サービス
MTR CORP	345	1,509	21,236	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	340	4,103	57,740	不動産
SINO LAND CO	740	994	13,993	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	631.69	6,247	87,901	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	320	2,187	30,773	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	125	974	13,709	不動産
FIRST PACIFIC CO	560	334	4,703	金融
CLP HOLDINGS LTD	375	3,103	43,660	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	279.24	1,271	17,896	不動産
HANG LUNG GROUP LTD	210	712	10,031	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,992.56	2,909	40,931	公益事業
HANG SENG BANK LTD	179	2,908	40,926	金融
WHEELOCK & CO LTD	200	1,243	17,489	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,310	1,385	19,500	不動産
WH GROUP LTD	1,850	1,393	19,600	生活必需品

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2017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	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR LI & FUNG LTD	273	5,476	77,052	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,320	381	5,367	一般消費財・サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	520	1,060	14,925	不動産
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	58	654	9,213	情報技術
NWS HOLDINGS LTD	165	527	7,417	一般消費財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	355	538	7,582	資本財・サービス
BANK OF EAST ASIA LTD	180	492	6,926	不動産
HYSAN DEVELOPMENT CO	290.4	974	13,708	金融
SJM HOLDINGS LTD	140	531	7,475	不動産
SWIRE PROPERTIES LTD	470	399	5,620	一般消費財・サービス
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	300	771	10,847	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	616.69	3,764	52,972	不動産
PCCW LTD	150	989	13,918	公益事業
AIA GROUP LTD	950	419	5,907	電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	2,812	15,733	221,365	金融
SHANGRI-LA ASIA LTD	572	2,124	29,898	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	300	387	5,453	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	315	1,145	16,110	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	200	341	4,800	一般消費財・サービス
WYNN MACAU LTD	875	3,049	42,904	金融
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	380	698	9,827	一般消費財・サービス
	870	880	12,387	電気通信サービス
香港ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	22,449.58 39銘柄	77,592 <1.3%>	
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	303	717	57,185	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	415	854	68,102	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	124.7	125	9,978	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	345	220	17,570	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	132	100	8,006	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	112	119	9,551	不動産
CAPITALAND LTD	590	212	16,928	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	410	129	10,325	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	23	103	8,259	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	742	795	63,395	金融
GENTING SINGAPORE PLC	1,530	178	14,206	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,886.5	711	56,683	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	350	131	10,516	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	227	71	5,680	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,644	61	4,913	生活必需品
SATS LTD	160	81	6,516	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	190	138	11,054	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	468	113	9,026	資本財・サービス
STARHUB LTD	160	44	3,519	電気通信サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	485	170	13,606	生活必需品
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	690	202	16,112	不動産
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	10,987.2 21銘柄	421,139 <0.5%>	
(ニュージーランド)	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	260	75	6,015	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	526.89	196	15,584	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	234	162	12,949	資本財・サービス
CONTACT ENERGY LTD	130	66	5,281	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	201	154	12,289	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	88	74	5,884	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 >	1,439.89 6銘柄	58,005 <0.1%>	
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT	163	80	11,256	一般消費財・サービス
TUI AG-DI	117.47	136	19,031	一般消費財・サービス
BP PLC	4,498	2,076	290,491	エネルギー
UNILEVER PLC	295.6	1,253	175,438	生活必需品
BARCLAYS PLC	3,955	804	112,605	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	434	388	54,405	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	381	140	19,685	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	21.5	160	22,455	素材
PRUDENTIAL PLC	592	1,046	146,437	金融
INMARSAT PLC	103	84	11,773	電気通信サービス
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	838.91	209	29,331	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	45.64	140	19,654	素材
BAE SYSTEMS PLC	727	479	67,080	資本財・サービス
AVIVA PLC	939.66	500	70,072	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,135.02	1,911	267,499	ヘルスケア
WORLDPAY GROUP PLC	427	134	18,818	情報技術
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	80	64	9,054	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	224	91	12,749	情報技術
DCC PLC	20	146	20,440	資本財・サービス
CONVATEC GROUP PLC	275	89	12,465	ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC	224	98	13,824	資本財・サービス
RELX PLC	255.46	432	60,474	資本財・サービス

銘柄	2017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	
DIAGEO PLC	586	1,366	191,153	生活必需品
RIO TINTO PLC	286.5	900	125,964	素材
STANDARD CHARTERED PLC	761	575	80,503	金融
TESCO PLC	1,911	355	49,703	生活必需品
FRESNILLO PLC	50	84	11,752	素材
SMITH & NEPHEW PLC	203	273	38,200	ヘルスケア
GLENCORE PLC	2,851.25	817	114,349	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	65	90	12,622	金融
SMITHS GROUP PLC	93.33	149	20,905	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	61	55	7,727	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	310.83	113	15,842	金融
DIXONS CARPHONE PLC	248	79	11,113	一般消費財・サービス
PEARSON PLC	188.63	136	19,054	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	381.25	102	14,273	生活必需品
NEXT PLC	33	141	19,857	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	739	133	18,714	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	43.11	173	24,288	一般消費財・サービス
IMI PLC	66.5	83	11,630	資本財・サービス
BUNZL PLC	77.55	185	25,964	資本財・サービス
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	206	60	8,519	金融
GKN PLC	406	142	19,903	一般消費財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	6,136.83	1,367	191,382	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	29.93	118	16,628	素材
KINGFISHER PLC	519.11	161	22,536	一般消費財・サービス
WPP PLC	298	501	70,211	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	159.27	155	21,793	公益事業
SEVERN TRENT PLC	57.33	142	19,916	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	154	1,211	169,460	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	119	143	20,012	金融
SCHRODERS PLC	32	99	13,982	金融
TATE & LYLE PLC	114	83	11,627	生活必需品
SSE PLC	239	355	49,789	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	54	99	13,863	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	227	134	18,865	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	290.5	1,539	215,453	ヘルスケア
WOLSELEY PLC	59.65	288	40,309	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,381	356	49,907	金融
3I GROUP PLC	229.91	205	28,789	金融
SKY PLC	245	236	33,129	一般消費財・サービス
ASHTREAD GROUP PLC	114	179	25,152	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	242.14	169	23,646	情報技術
NATIONAL GRID PLC	802.34	814	113,995	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	16,499.65	1,120	156,744	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	242.6	151	21,196	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	222.5	797	111,538	生活必需品
CENTRICA PLC	1,283.6	260	36,438	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	30	97	13,628	一般消費財・サービス
PROVIDENT FINANCIAL PLC	36.5	108	15,182	金融
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	433.6	2,361	330,381	生活必需品
BHP BILLITON PLC	485.77	572	80,095	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	81	244	34,247	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	4,600	3,131	438,088	金融
SHIRE PLC	210.74	902	126,208	ヘルスケア
OLD MUTUAL PLC	1,170.25	239	33,515	金融
ANGLO AMERICAN PLC	320.83	339	47,535	素材
MONDI PLC	83	170	23,794	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	509	124	17,426	生活必需品
CARNIVAL PLC	45.11	229	32,124	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	35	48	6,723	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	377.41	628	87,864	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	70.5	170	23,889	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	1,966	585	81,886	電気通信サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	44	101	14,226	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	104.89	180	25,314	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	42.86	188	26,438	一般消費財・サービス
CAPITA PLC	150.9	98	13,775	資本財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC	59	93	13,108	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	38	164	23,042	資本財・サービス
ITV PLC	868	160	22,442	一般消費財・サービス
PETROFAC LTD	56	22	3,173	エネルギー
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	71.49	259	36,327	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,007	2,116	296,079	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	872.18	1,868	261,381	エネルギー
MEGGITT PLC	177	88	12,419	資本財・サービス
G4S PLC	346	113	15,824	資本財・サービス
COBHAM PLC	556	74	10,431	資本財・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	33	55	7,724	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	52	109	15,387	金融
INVESTEC PLC	160	93	13,084	金融
ANTOFAGASTA PLC	98	78	10,920	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2017年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
STANDARD LIFE PLC	454.63	千イギリス・ポンド	177	金融
EXPERIAN PLC	220.54		24,895	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	70,938.77		49,986	
	104銘柄		6,092,048	<7.1%>
(イスラエル)	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額
AZRIELI GROUP LTD	10	194	6,046	不動産
FRUTAROM	9	214	6,666	素材
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	564	352	10,966	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD	140	217	6,776	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	6	267	8,335	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	265	638	19,893	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	334	571	17,801	金融
NICE LTD	14	393	12,271	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	30	190	5,929	金融
イスラエル・シケル通貨計	1,372	3,039	94,688	
	9銘柄		<0.1%>	
(スイス)	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額
DUFFRY AG-REG	10.5	168	18,978	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	855	1,333	150,679	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	136	15,375	素材
ADECCO GROUP AG-REG	37.5	275	31,137	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	163.5	4,089	461,949	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	8	59	6,728	金融
SIKA AG-BR	0.5	314	35,472	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	139	15,781	生活必需品
ABB LTD-REG	462	1,125	127,140	資本財・サービス
SWISS RE AG	75.5	666	75,313	金融
NESTLE SA-REG	724	5,839	659,638	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	4.2	251	28,373	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	204	23,102	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	532.2	701	79,241	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	52	262	29,695	金融
SGS SA-REG	1.3	304	34,424	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	5	99	11,263	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	9	99	11,245	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7	258	29,156	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	35.22	1,010	114,151	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	12	180	20,348	金融
NOVARTIS AG-REG	518.5	4,072	460,106	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.5	68	7,693	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	122	969	109,569	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	5.9	271	30,680	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG	8.5	382	43,201	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	2.1	417	47,186	素材
ACTELION LTD-REG	22.5	596	67,358	ヘルスケア
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2	108	12,291	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	12	198	22,368	ヘルスケア
LONZA GROUP AG-REG	17.5	350	39,579	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	11	79	9,021	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	104.9	593	67,014	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	7.7	250	28,322	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	12.5	198	22,368	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	16.5	149	16,850	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.23	133	15,031	生活必需品
スイス・フラン通貨計	3,870.77	26,359	2,977,839	
	37銘柄		<3.5%>	
(デンマーク)	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額
NOVO NORDISK A/S-B	445.5	13,008	215,422	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	158.5	3,972	65,776	金融
ISS A/S	39	1,058	17,528	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.85	1,025	16,975	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	5	175	2,904	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52	3,179	52,657	資本財・サービス
TDC A/S	193	734	12,157	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B	24.5	1,750	28,988	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	55	1,664	27,560	素材
COLOPLAST-B	28	1,622	26,870	ヘルスケア
DSV A/S	42.5	1,736	28,750	資本財・サービス
WILLIAM DEMANT HOLDING	26.75	457	7,579	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1.5	1,893	31,348	資本財・サービス
TRYG A/S	25	352	5,829	金融
PANDORA A/S	25.5	1,675	27,743	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	23.5	1,129	18,699	素材
GENMAB A/S	13	1,836	30,419	ヘルスケア
DONG ENERGY A/S	34	1,025	16,981	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	1,193.1	38,296	634,192	
	18銘柄		<0.7%>	
(ノルウェー)	株数、金額	株数、金額	株数、金額	株数、金額
NORSK HYDRO ASA	306	1,388	18,093	素材

銘柄	2017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	千ノルウェー・クローネ	千円	
DNB ASA	225.5	3,247	42,311	金融
ORKLA ASA	190.5	1,612	21,011	生活必需品
TELENOR ASA	180	2,520	32,835	電気通信サービス
STATOIL ASA	259.73	3,812	49,681	エネルギー
SCHIBSTED ASA-CL A	15	297	3,875	一般消費財・サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	41.6	1,314	17,128	素材
MARINE HARVEST	87	1,264	16,482	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	48.5	666	8,683	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	18	333	4,338	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 >	1,371.83 10銘柄	16,457 <0.2%>	
	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)				
ICA GRUPPEN AB	19	604	7,621	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	710.3	4,418	55,711	情報技術
VOLVO AB-B SHS	353	5,125	64,633	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	15	760	9,589	電気通信サービス
SKF AB-B SHARES	94.5	1,694	21,366	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	54.5	1,547	19,510	一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB	708.5	7,864	99,169	金融
SWEDISH MATCH AB	45.5	1,380	17,401	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	89.5	803	10,134	電気通信サービス
GETINGE AB-B SHS	47	816	10,294	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	349.5	3,641	45,922	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	352	4,308	54,329	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	209	4,368	55,081	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	218	4,625	58,333	一般消費財・サービス
SKANSKA AB-B SHS	76.5	1,579	19,920	資本財・サービス
SANDVIK AB	262.5	3,591	45,282	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	104	4,264	53,769	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	157	5,071	63,946	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	74	1,101	13,885	資本財・サービス
TELIA CO AB	600	2,364	29,810	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB	70	1,208	15,235	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	91	2,639	33,289	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	233	4,480	56,500	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	9	626	7,904	金融
LUNDIN PETROLEUM AB	42	704	8,887	エネルギー
BOLIDEN AB	65	1,520	19,171	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	97.5	827	10,438	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B	53	1,394	17,590	金融
HEXAGON AB-B SHS	62	2,594	32,719	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	35	729	9,202	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,296.8 30銘柄	966,654 <1.1%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (アイルランド)				
BANK OF IRELAND	6,618	148	18,250	金融
KERRY GROUP PLC-A	38.5	299	36,913	生活必需品
CRH PLC	194	626	77,083	素材
PADDY POWER BETFAIR PLC	19	187	23,086	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,869.5 4銘柄	1,261 <0.2%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オランダ)				
QIAGEN N. V.	52.48	160	19,711	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	219.76	706	87,021	資本財・サービス
NN GROUP NV	74.5	238	29,303	金融
UNILEVER NV-CVA	379.5	1,865	229,630	生活必需品
HEINEKEN NV	53	460	56,635	生活必需品
RELX NV	227.19	419	51,659	資本財・サービス
AEGON NV	407.44	183	22,561	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	294.83	567	69,852	生活必需品
AKZO NOBEL	58	448	55,195	素材
KONINKLIJKE DSM NV	41	273	33,641	素材
WOLTERS KLUWER	69	267	32,980	資本財・サービス
BOSKALIS WESTMINSTER	21	62	7,696	資本財・サービス
ING GROEP NV	903.5	1,357	167,122	金融
KONINKLIJKE KPN NV	782.5	237	29,189	電気通信サービス
ASML HOLDING NV	86	1,003	123,555	情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA	66	150	18,480	金融
VOPAK	16	68	8,418	エネルギー
RANDSTAD HOLDING NV	26	134	16,618	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	23	188	23,221	生活必需品
GEMALTO	20	109	13,455	情報技術
ALTICE NV - A	84	190	23,453	一般消費財・サービス
ALTICE NV - B	29	65	8,090	一般消費財・サービス
AIRBUS SE	135.5	1,018	125,327	資本財・サービス
EXOR NV	25	123	15,204	金融
CNH INDUSTRIAL NV	243	240	29,646	資本財・サービス

銘柄	2017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	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	250.5	242	29,867	一般消費財・サービス
FERRARI NV	28.35	222	27,415	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,616.05 27銘柄	11,006 <1.6%>	
ユーロ (ベルギー)		百株	千ユーロ	千円
UCB SA	27.5	170	20,949	ヘルスケア
KBC GROEP NV	58	391	48,161	金融
COLRUYT SA	16	76	9,423	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	18.5	158	19,532	金融
SOLVAY SA	17	206	25,386	素材
UMICORE	22.5	139	17,154	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	177	1,791	220,519	生活必需品
AGEAS	44.9	165	20,336	金融
PROXIMUS	35	112	13,816	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	12	70	8,631	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	428.4 10銘柄	3,280 <0.5%>	
ユーロ (ルクセンブルグ)		百株	千ユーロ	千円
RTL GROUP	10	68	8,471	一般消費財・サービス
ARCELORMITTAL	141	261	32,243	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	2.7	131	16,199	ヘルスケア
SES	83.5	187	23,134	一般消費財・サービス
TENARIS SA	105.5	143	17,702	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	342.7 5銘柄	794 <0.1%>	
ユーロ (フランス)		百株	千ユーロ	千円
JCDECAUX SA	16	47	5,797	一般消費財・サービス
TOTAL SA	528.5	2,365	291,192	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	42.5	512	63,047	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	90.48	982	120,969	素材
KERING	18	540	66,490	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	132	883	108,748	資本財・サービス
BOUYGUES SA	50	191	23,603	資本財・サービス
BNP PARIBAS	258.5	1,613	198,581	金融
PEUGEOT SA	112.5	199	24,590	一般消費財・サービス
NATIXIS	229.5	133	16,423	金融
THALES SA	25.5	246	30,379	資本財・サービス
DANONE	138.5	922	113,557	生活必需品
CARREFOUR SA	128	300	37,031	生活必需品
SUEZ	74.75	123	15,174	公益事業
VIVENDI	237.41	471	58,016	一般消費財・サービス
L'OREAL	58.5	1,100	135,468	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	115	561	69,160	資本財・サービス
LEGRAND SA	60.67	366	45,128	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	13	70	8,619	生活必需品
PERNOD RICARD SA	49.17	596	73,457	生活必需品
SOCIETE BIC SA	7	76	9,393	資本財・サービス
EURAZEO SE	8.66	56	6,941	金融
REXEL SA	70.5	105	12,975	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA	180	834	102,710	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	64.4	1,467	180,685	一般消費財・サービス
ACCOR SA	40	168	20,682	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	37.5	346	42,629	情報技術
VALEO SA	56.5	342	42,165	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	43.5	291	35,933	一般消費財・サービス
BUREAU VERITAS SA	60.5	124	15,276	資本財・サービス
IEFFAGE	17	141	17,370	資本財・サービス
SODEXO SA	21.5	258	31,775	一般消費財・サービス
IPSEN	9	104	12,874	ヘルスケア
INGENICO GROUP	13.5	109	13,483	情報技術
ZODIAC AEROSPACE	48	113	14,013	資本財・サービス
SEB SA	5	78	9,704	一般消費財・サービス
ESSILOR INTERNATIONAL	47.5	570	70,201	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA	0.6	78	9,667	資本財・サービス
AXA SA	455	1,094	134,688	金融
CHRISTIAN DIOR SE	13	332	40,890	一般消費財・サービス
LAGARDERE SCA	26.5	74	9,177	一般消費財・サービス
EDENRED	47.5	111	13,759	資本財・サービス
RENAULT SA	44	363	44,797	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	6.2	272	33,542	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	5.5	56	6,957	生活必需品
ATOS SE	21.5	272	33,601	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA	30.5	250	30,864	情報技術
WENDEL	6	83	10,219	金融
ORANGE	468	695	85,587	電気通信サービス
ALSTOM	36.5	113	13,932	資本財・サービス

銘柄	2017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	
CNP ASSURANCES	37.5	74	9,200	金融
SANOFI	267.75	2,272	279,721	ヘルスケア
VINCI SA	119	934	115,076	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	114.5	223	27,501	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	257	357	43,962	金融
ENGIE	395.73	547	67,426	公益事業
IMERYS SA	9	70	8,689	素材
EDF	127.5	125	15,399	公益事業
SAFRAN SA	72	561	69,156	資本財・サービス
ILIAD SA	6	131	16,246	電気通信サービス
ARKEMA	15.5	148	18,253	素材
ADP	7.5	103	12,760	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	40.5	97	12,063	一般消費財・サービス
SCOR SE	36.5	126	15,563	金融
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	104.5	106	13,083	資本財・サービス
BOLLORE	190	77	9,597	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,069.82 66銘柄	27,176 3,345,648	<3.9%>
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ドイツ)				
BAYER AG-REG	191.5	2,325	286,325	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	38	111	13,784	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	476.5	727	89,606	金融
COMMERZBANK AG	246.85	229	28,262	金融
VOLKSWAGEN AG	8	110	13,591	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	43	569	70,088	一般消費財・サービス
MAN SE	8.5	80	9,895	資本財・サービス
SIEMENS AG-REG	177	2,243	276,194	資本財・サービス
E. ON SE	517	455	56,118	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	76	639	78,696	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	42	156	19,255	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG	21.6	149	18,436	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	25.5	507	62,425	一般消費財・サービス
BASF SE	212.5	1,831	225,454	素材
LINDE AG	43	765	94,201	素材
K+S AG-REG	44	105	12,948	素材
ALLIANZ SE-REG	106.5	1,852	228,069	金融
THYSSENKRUPP AG	85	202	24,978	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	41	518	63,851	生活必需品
RWE AG	118	233	28,763	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50.5	95	11,719	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	9	68	8,442	資本財・サービス
BRENNTAG AG	36.5	187	23,047	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	96.5	759	93,472	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	27	132	16,260	情報技術
HOCHTIEF AG	5	84	10,362	資本財・サービス
SAP SE	227.42	2,143	263,878	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	37.2	663	81,701	金融
SCHAEFFLER AG	38	56	6,977	一般消費財・サービス
ZALANDO SE	26	113	13,912	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	35	302	37,262	素材
COVESTRO AG	26	169	20,824	素材
INNOGY SE	34	121	14,907	公益事業
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	34.5	175	21,567	一般消費財・サービス
BEIERSDORF AG	23	221	27,270	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF	15	75	9,266	素材
MERCK KGAA	29.5	316	39,004	ヘルスケア
ADIDAS AG	44.1	783	96,421	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	24	266	32,826	生活必需品
METRO AG	41	119	14,698	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	758	1,273	156,726	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	50.5	448	55,269	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	225	1,478	182,015	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	259	508	62,591	情報技術
HANNOVER RUECK SE	14	149	18,355	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	232	762	93,881	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	44.5	418	51,502	金融
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	55.5	207	25,598	一般消費財・サービス
LANXESS AG	22	152	18,728	素材
AXEL SPRINGER SE	10	55	6,807	一般消費財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	84	295	36,328	不動産
SYMRISE AG	30	192	23,637	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	165	73	9,055	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	12	88	10,845	一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD	16.5	108	13,410	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	109	395	48,677	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,467.67 56銘柄	27,278 3,358,205	<3.9%>

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2017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	
ユーロ (ポルトガル)		百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS		60	108	13,343	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		495	157	19,336	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		116.5	155	19,089	エネルギー
国	小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	671.5 3銘柄	420 <0.1%>	51,769
ユーロ (スペイン)		百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA		1,046.27	1,020	125,599	電気通信サービス
ENDESA SA		76.5	166	20,554	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		1,537.12	1,123	138,330	金融
IBERDROLA SA		1,329.34	939	115,704	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		1,229.09	212	26,192	金融
BANKINTER SA		151	122	15,076	金融
REPSOL SA		258	364	44,896	エネルギー
GRIFOLS SA		67	170	20,930	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		3,365.5	1,995	245,695	金融
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		158	258	31,773	資本財・サービス
AMADEUS IT GROUP SA		101	540	66,485	情報技術
GAS NATURAL SDG SA		84.5	182	22,506	公益事業
MAPFRE SA		254.5	82	10,185	金融
CAIXABANK S. A		816	327	40,293	金融
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		201	137	16,982	資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		53.76	193	23,819	資本財・サービス
AENA SA		16	289	35,613	資本財・サービス
REPSOL SA-RTS		258	10	1,311	その他
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		253	890	109,683	一般消費財・サービス
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA		56	112	13,826	資本財・サービス
ENAGAS SA		54	141	17,381	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA		100	202	24,960	公益事業
FERROVIAL SA		117	239	29,513	資本財・サービス
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		157	89	10,959	生活必需品
BANKIA SA		271.05	110	13,627	金融
国	小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,010.63 25銘柄	9,925 <1.4%>	1,221,903
ユーロ (イタリア)		百株	千ユーロ	千円	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA		217.5	42	5,282	金融
PRYSMIAN SPA		48	124	15,334	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		290.43	421	51,880	金融
SAIPEM SPA		134.3	47	5,849	エネルギー
MEDIOBANCA SPA		130.15	110	13,659	金融
UNICREDIT SPA		439.56	697	85,879	金融
TELECOM ITALIA SPA		2,662.82	221	27,323	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP		1,349.5	93	11,513	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO-RSP		210	50	6,194	金融
INTESA SANPAOLO		2,938.97	757	93,276	金融
ATLANTIA SPA		106.07	277	34,186	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		118	75	9,340	金融
RECORDATI SPA		26	94	11,683	ヘルスケア
ENI SPA		588	814	100,258	エネルギー
LEONARDO SPA		95.25	149	18,445	資本財・サービス
ENEL SPA		1,878.34	911	112,245	公益事業
SNAM SPA		582	239	29,519	エネルギー
LUXOTTICA GROUP SPA		38.5	210	25,950	一般消費財・サービス
TERNA SPA		354	181	22,313	公益事業
国	小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,207.39 19銘柄	5,524 <0.8%>	680,136
ユーロ (フィンランド)		百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ		124	315	38,881	素材
NOKIA OYJ		1,341.5	763	94,054	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		32	170	21,017	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		131	152	18,788	素材
METSO OYJ		24	74	9,180	資本財・サービス
ELISA OYJ		32.5	113	14,027	電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS		103	470	57,974	金融
FORTUM OYJ		104.5	149	18,396	公益事業
KONE OYJ-B		78.5	368	45,324	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ		26.5	98	12,080	一般消費財・サービス
NESTE OYJ		29.5	102	12,656	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		24.5	141	17,373	ヘルスケア
国	小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,051.5 12銘柄	2,922 <0.4%>	359,756
ユーロ (オーストリア)		百株	千ユーロ	千円	
OMV AG		35.5	166	20,523	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		66.5	214	26,439	金融
VOESTALPINE AG		28.5	114	14,036	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		24	53	6,582	金融
ANDRITZ AG		16	86	10,650	資本財・サービス
国	小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	170.5 5銘柄	635 <0.1%>	78,232

銘柄	2017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	
ユーロ (その他)	百株	千ユーロ	千円	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	52	189	23,270	生活必需品
STMICROELECTRONICS NV	153	212	26,181	情報技術
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	205 401	49,452	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2 <0.1%>	<0.1%>	
ファンダ合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	51,110.66 90,626	11,157,058	
		234銘柄	<12.9%>	
	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	267,640.91 1,261銘柄	82,741,832	
			<96.0%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2017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	2017年6月15日現在		
	口数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3.097	604	66,377
SIMON PROPERTY GROUP INC	7.087	1,131	124,133
BOSTON PROPERTIES INC	3.55	449	49,319
GGP INC	12.8	307	33,762
VORNADO REALTY TRUST	3.827	360	39,499
SBA COMMUNICATIONS CORP	2.75	365	40,102
EQUITY RESIDENTIAL	8.2	550	60,451
EQUINIX INC	1.758	759	83,346
AMERICAN TOWER CORP	9.75	1,272	139,604
HOST HOTELS & RESORTS INC	17.293	321	35,234
KIMCO REALTY CORP	10	192	21,132
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	12	170	18,656
VENTAS INC	7.9	542	59,548
WEYERHAEUSER CO	16.814	567	62,299
AGNC INVESTMENT CORP	7.8	168	18,519
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6.9	132	14,565
CROWN CASTLE INTL CORP	8.25	840	92,247
IRON MOUNTAIN INC	5.61	191	21,044
VEREIT INC	22.3	188	20,724
PROLOGIS INC	11.912	688	75,582
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.9	226	24,801
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	175	19,249
DUKE REALTY CORP	8	230	25,340
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.48	388	42,627
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1.6	203	22,293
WELLTOWER INC	8.4	625	68,607
HCP INC	10.7	342	37,532
LIBERTY PROPERTY TRUST	3.3	139	15,344
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2.6	283	31,060
MACERICH CO/THE	2.7	158	17,436
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23.2	285	31,284
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3.4	133	14,616
REALTY INCOME CORP	6	341	37,491
PUBLIC STORAGE	3.35	703	77,143
REGENCY CENTERS CORP	3.5	222	24,381
SL GREEN REALTY CORP	2.25	239	26,227
UDR INC	6.3	250	27,442
DIGITAL REALTY TRUST INC	3.7	434	47,680
EXTRA SPACE STORAGE INC	2.75	207	22,750
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	276.728 39銘柄	1,689,467
			<2.0%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	1.5	49	4,063
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3	68	5,657
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3.3	82	6,868
カナダ・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	7.8 3銘柄	16,589
			<0.0%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円
SCENTRE GROUP	122.222	525	43,768
DEXUS	23.95	253	21,102
GPT GROUP	44.06	230	19,190
MIRVAC GROUP	84.4	193	16,096
STOCKLAND	57	274	22,880

銘柄		2017年6月15日現在		
		□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
WESTFIELD CORP		45.496	394	32,887
GOODMAN GROUP		41.7	358	29,865
VICINITY CENTRES		82.873	237	19,807
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	501.701 8銘柄	2,468	205,598 <0.2%>
(香港)		千口	千香港ドル	千円
LINK REIT		52	3,307	46,532
香港ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	52 1銘柄	3,307	46,532 <0.1%>
(シンガポール)		千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		46	75	6,012
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		57.4	154	12,351
CAPITALAND MALL TRUST		63.2	122	9,746
SUNTEC REIT		53	98	7,814
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	219.6 4銘柄	450	35,925 <0.0%>
(イギリス)		千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC		18.2	197	27,577
SEGRO PLC		23.75	119	16,713
HAMMERSON PLC		19.2	117	16,372
BRITISH LAND CO PLC		22.1	142	20,005
INTU PROPERTIES PLC		21.1	57	8,012
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	104.35 5銘柄	633	88,681 <0.1%>
(ユーロ (フランス))		千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO SE		2.35	548	67,539
ICADE		0.9	66	8,240
GECINA SA		0.95	131	16,209
KLEPIERRE		5.2	196	24,140
FONCIERE DES REGIONS		0.75	62	7,663
ユーロ通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	10.15 5銘柄	1,005	123,793 <0.1%>
ファンド合計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,172.329 65銘柄	—	2,206,588 <2.6%>

(注1) 邦貨換算金額は、2017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		2017年6月15日現在	
		買建額	売建額
外国	S&P500 (アメリカ)	百万円 1,202	百万円 —

(注1) 外貨建の評価額は、2017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17期 (決算日 2016年11月30日)

(計算期間 2015年12月1日～2016年11月30日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

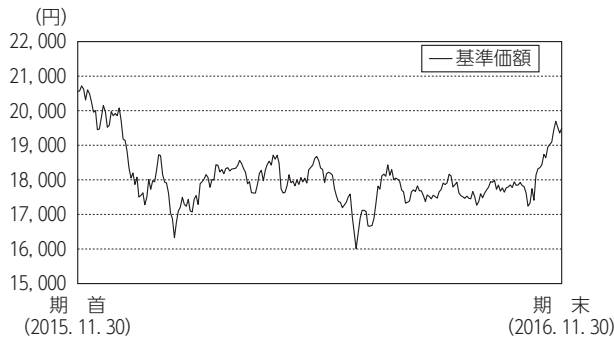
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数(円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の株式(預託証券を含みます。)
運用方法	①主として外国の株式(預託証券を含みます。)に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数(円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
株式組入制限	無制限

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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

■当期中の基準価額と市況の推移



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

- (注1) 騰落率は期首比。
 (注2) MSCIコクサイ指数(円ベース)は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(米ドルベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
 (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
 (注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：20,561円 期末：19,489円 騰落率：△5.2%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外株式市況

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

○為替相場

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (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)	11 (11)
(その他)	(0)
合 計	13

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

(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	アメリカ	百株 6,789.3 (△ 562.1)	千アメリカ・ドル 36,898 (△ 5,801)	百株 2,127.84	千アメリカ・ドル 8,628
	カナダ	百株 1,151.7 (98.1)	千カナダ・ドル 3,778 (△ 96)	百株 279.5	千カナダ・ドル 262
	オーストラリア	百株 3,136 (5.2)	千オーストラリア・ドル 2,839 (△ 190)	百株 265.5	千オーストラリア・ドル 165
	香港	百株 3,343 (182.29)	千香港ドル 5,446 (ー)	百株 70	千香港ドル 639
	シンガポール	百株 1,338 (ー)	千シンガポール・ドル 269 (△ 15)	百株 2,301.81	千シンガポール・ドル 73
	ニュージーランド	百株 313 (ー)	千ニュージーランド・ドル 112 (ー)	百株 ー	千ニュージーランド・ドル ー
	イギリス	百株 8,747 (△ 17,827.63)	千イギリス・ポンド 4,235 (△ 1,486)	百株 438.74	千イギリス・ポンド 306
	イスラエル	百株 27 (ー)	千イスラエル・シケル 550 (ー)	百株 206	千イスラエル・シケル 3,305
	スイス	百株 311.63 (ー)	千スイス・フラン 2,111 (△ 244)	百株 187.5	千スイス・フラン 504
	デンマーク	百株 136 (27)	千デンマーク・クローネ 5,106 (ー)	百株 19	千デンマーク・クローネ 704
国	ノルウェー	百株 222 (ー)	千ノルウェー・クローネ 3,291 (△ 47)	百株 ー	千ノルウェー・クローネ ー
	スウェーデン	百株 392.5 (ー)	千スウェーデン・クローネ 4,855 (△ 120)	百株 ー	千スウェーデン・クローネ ー
	ユーロ (アイルランド)	百株 42.5 (ー)	千ユーロ 350 (ー)	百株 ー	千ユーロ ー
	ユーロ (オランダ)	百株 454 (15.3)	千ユーロ 886 (△ 122)	百株 27	千ユーロ 49
	ユーロ (ベルギー)	百株 32 (△ 23)	千ユーロ 249 (△ 7)	百株 14	千ユーロ 107
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 224 (ー)	千ユーロ 112 (△ 21)	百株 ー	千ユーロ ー
	ユーロ (フランス)	百株 562 (35.51)	千ユーロ 2,171 (△ 69)	百株 661	千ユーロ 347
	ユーロ (ドイツ)	百株 540.5 (46.5)	千ユーロ 2,206 (△ 47)	百株 64.5	千ユーロ 232

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	ユーロ (スペイン)	百株 1,638.5 (869.43)	千ユーロ 810 (△ 21)	百株 41	千ユーロ 57
	ユーロ (イタリア)	百株 2,503 (△ 78.16)	千ユーロ 536 (△ 45)	百株 942.65	千ユーロ 183
	ユーロ (フィンランド)	百株 621.5 (ー)	千ユーロ 473 (ー)	百株 5	千ユーロ 19
	ユーロ (オーストリア)	百株 11 (ー)	千ユーロ 28 (△ 2)	百株 ー	千ユーロ ー
国	ユーロ (その他)	百株 21 (47)	千ユーロ 30 (156)	百株 ー	千ユーロ ー
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 6,650 (912.58)	千ユーロ 7,856 (△ 181)	百株 1,755.15	千ユーロ 998

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
株 式

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国株式

銘 柄	株 数	期 首	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	千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)						
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	—	27	180	20,303	情報技術	
PALO ALTO NETWORKS INC	15	21	280	31,535	情報技術	
JARDEN CORP	40	—	—	—	その他	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	13	14.5	153	17,252	ヘルスクエア	
SYNCHRONY FINANCIAL	38	196	662	74,476	金融	
ABBOTT LABORATORIES	317	341	1,320	148,472	ヘルスクエア	
ARCONIC INC	273	103.33	203	22,849	資本財・サービス	
VERISK ANALYTICS INC	33	37.5	314	35,361	資本財・サービス	
LAS VEGAS SANDS CORP	87	101	627	70,567	一般消費財・サービス	
AMPHENOL CORP-CL A	66	72	492	55,388	情報技術	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	60.29	71.79	566	63,677	情報技術	
QORVO INC	32	32	173	19,526	情報技術	
AFLAC INC	91	97	691	77,728	金融	
DARDEN RESTAURANTS INC	29	27.5	200	22,531	一般消費財・サービス	
ADOBE SYSTEMS INC	107	114.5	1,201	135,092	情報技術	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	50	50	137	15,418	素材	
LULULEMON ATHLETICA INC	25	25	145	16,390	一般消費財・サービス	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	68	68	125	14,134	金融	
GARMIN LTD	26	26	135	15,196	一般消費財・サービス	
AETNA INC	74.79	80.79	1,066	119,915	ヘルスクエア	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	43	47.5	681	76,612	素材	
ALTERA CORP	65	—	—	—	その他	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	158	166	1,881	211,511	資本財・サービス	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	37.51	37.51	189	21,337	情報技術	
WR BERKLEY CORP	21	21	130	14,684	金融	
AUTOZONE INC	6.7	6.7	529	59,521	一般消費財・サービス	
DOLLAR TREE INC	47.21	55.71	499	56,159	一般消費財・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	—	209	791	88,955	ヘルスクエア	
PINNACLE WEST CAPITAL	24	26.5	203	22,843	公益事業	
CELANESE CORP-SERIES A	33	33	254	28,625	素材	
DR HORTON INC	71.66	79.66	229	25,827	一般消費財・サービス	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	21	21	99	11,145	エネルギー	
DENTSPLY SIRONA INC	30	55	332	37,389	ヘルスクエア	
AUTODESK INC	48	45.5	342	38,496	情報技術	
MOODY'S CORP	39	40.5	409	46,026	金融	
DEVON ENERGY CORP	82	109	459	51,661	エネルギー	
ALBEMARLE CORP	24	26	223	25,122	素材	
ATMOS ENERGY CORP	—	23	170	19,172	公益事業	
ALLIANT ENERGY CORP	25	50	186	20,938	公益事業	
CITIGROUP INC	643.23	661.23	3,671	412,710	金融	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	101	106	1,028	115,637	情報技術	
AMERICAN ELECTRIC POWER	105	115	704	79,211	公益事業	
NETSUITE INC	8	—	—	—	その他	
ALLEGHANY CORP	3.5	3.5	199	22,384	金融	
DUN & BRADSTREET CORP	7.5	9	110	12,455	資本財・サービス	
DOMINO'S PIZZA INC	—	11	187	21,130	一般消費財・サービス	
HESS CORP	57	65	318	35,842	エネルギー	
DAVITA INC	36	38	241	27,195	ヘルスクエア	
DANAHER CORP	131	142.5	1,127	126,765	ヘルスクエア	
FORTIVE CORP	—	72	398	44,744	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		
AVNET INC	28	28	129	14,508	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	23.7	135	740	83,229	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	38	40	123	13,895	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	—	40.28	104	11,710	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	134	134	573	64,429	生活必需品
BUNGE LTD	31	31	208	23,387	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	88.25	82.25	552	62,155	情報技術
APPLE INC	1,211	1,239	13,809	1,552,508	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	94	94	635	71,457	金融
BOEING CO/THE	139	135	2,047	230,139	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	32.15	34.65	267	30,037	金融
SPECTRA ENERGY CORP	140.96	159.96	657	73,944	エネルギー
BECTON DICKINSON AND CO	44.37	48.87	844	94,897	ヘルスケア
CDK GLOBAL INC	29	29	170	19,120	情報技術
NISOURCE INC	—	73	163	18,358	公益事業
COLUMBIA PIPELINE GROUP	67	—	—	—	その他
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	31	33.5	251	28,237	資本財・サービス
CR BARD INC	16	16.8	362	40,772	ヘルスケア
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	240.71	250.71	1,179	132,609	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	871.54	936.04	4,770	536,250	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	248	275.5	4,344	488,361	金融
ANSYS INC	19	21	198	22,316	情報技術
H&R BLOCK INC	51	51	114	12,831	一般消費財・サービス
BB&T CORP	168	190	838	94,303	金融
BROADCOM CORP-CL A	116.5	—	—	—	その他
BAKER HUGHES INC	92.23	95.73	578	65,088	エネルギー
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	356	387	2,181	245,202	ヘルスケア
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	13	13	104	11,734	生活必需品
JPMORGAN CHASE & CO	781.2	826.7	6,524	733,463	金融
LEGG MASON INC	21.5	—	—	—	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	56	56	410	46,196	金融
CIGNA CORP	55.5	59	815	91,731	ヘルスケア
LKQ CORP	68	68	224	25,234	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	10	10	131	14,729	金融
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	221.42	258.42	94	10,661	電気通信サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	25	50	234	26,379	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	—	69	183	20,625	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	39.6	39.6	443	49,887	金融
DOLLAR GENERAL CORP	65	65	509	57,223	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	30	38	316	35,636	情報技術
CATERPILLAR INC	121	134	1,260	141,664	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	60	64	267	30,103	公益事業
MOSAIC CO/THE	68	75.5	204	22,967	素材
DELTA AIR LINES INC	44	44	213	24,034	資本財・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	44	43.5	315	35,459	生活必需品
CORNING INC	266	247	596	67,114	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,083	1,159	3,457	388,669	情報技術
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	192	200	1,424	160,086	素材
IONIS PHARMACEUTICALS INC	26	—	—	—	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	317	333	1,351	151,989	金融
WABCO HOLDINGS INC	11	12.5	123	13,829	資本財・サービス
DOW CHEMICAL CO/THE	239	258	1,392	156,594	素材
MSCI INC	—	22	177	19,941	金融
COTY INC-CL A	—	111.39	217	24,481	生活必需品
BROADCOM LTD	56	90.62	1,589	178,739	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	9	10.5	132	14,940	ヘルスケア
ENSCO PLC-CL A	49	—	—	—	エネルギー
DICK'S SPORTING GOODS INC	20	20	120	13,530	一般消費財・サービス
ACUITY BRANDS INC	9	10	252	28,347	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	15	—	—	—	ヘルスケア
ARAMARK	48	53.5	187	21,086	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	—	49	129	14,603	素材
DTE ENERGY COMPANY	38	42	402	45,233	公益事業
CENTENE CORP	22	40	230	25,901	ヘルスケア
CITIZENS FINANCIAL GROUP	90	122	395	44,423	金融
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	38	43	96	10,871	ヘルスケア
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	40.5	207	23,334	金融
GARTNER INC	17	19	197	22,231	情報技術
SPLUNK INC	26	29	166	18,706	情報技術
WHITEWAVE FOODS CO	36	41	225	25,396	生活必需品
AGCO CORP	17	17	94	10,675	資本財・サービス
DOMINION RESOURCES INC/VA	127	143	1,088	122,354	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	30	93	421	47,340	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	—	34	166	18,698	資本財・サービス
DEERE & CO	66	62	622	69,944	資本財・サービス
AIRGAS INC	15	—	—	—	その他
QUANTA SERVICES INC	49	—	—	—	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	—	36	254	28,568	情報技術
TIME WARNER INC	176.33	176.33	1,638	184,175	一般消費財・サービス
VMWARE INC-CLASS A	19	19	155	17,431	情報技術
BAXALTA INC	116	—	—	—	その他

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	
TEGNA INC	—	45	100	11,316	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	27	27	175	19,720	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	12	—	—	—	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	62	70	508	57,171	公益事業
MEDNAX INC	—	20	132	14,841	ヘルスケア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	26	26	189	21,296	一般消費財・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	21	21	196	22,078	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	184	194.5	1,294	145,472	生活必需品
AMETEK INC	52.25	52.25	240	27,008	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	29	58	260	29,237	生活必需品
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	10	—	—	—	情報技術
LYONDELLBASELL INDU-CL A	86	84	703	79,059	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	94	101.5	1,537	172,848	生活必需品
SCANA CORP	29	31	224	25,248	公益事業
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	26	—	—	—	その他
AFFILIATED MANAGERS GROUP	12	12	174	19,561	金融
WR GRACE & CO	—	16	107	12,053	素材
VALSPAR CORP/THE	—	17	173	19,537	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6.5	7	276	31,092	一般消費財・サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP	66	76	162	18,224	金融
UGI CORP	—	39	180	20,317	公益事業
CUMMINS INC	37	37	511	57,493	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	109	136	516	58,022	情報技術
SABRE CORP	—	46	119	13,460	情報技術
CDW CORP/DE	—	35.5	183	20,664	情報技術
SIGNATURE BANK	—	13	194	21,850	金融
AMERCO	—	1.7	58	6,533	資本財・サービス
HANESBRANDS INC	85	85	199	22,427	一般消費財・サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	107	122	302	34,027	一般消費財・サービス
TRANSDIGM GROUP INC	11	12	310	34,895	資本財・サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	28	29.5	294	33,100	電気通信サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	76	85	368	41,471	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	393.81	439.81	941	105,808	エネルギー
HCA HOLDINGS INC	71	71	507	57,085	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	88	105.5	243	27,349	エネルギー
T-MOBILE US INC	59.5	67.5	373	42,031	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	18	25	90	10,120	情報技術
COCA-COLA CO/THE	878	946.5	3,894	437,858	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	47	—	—	—	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	40	40	211	23,720	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	25	25	100	11,306	金融
FMC TECHNOLOGIES INC	49	49	161	18,178	エネルギー
FRANKLIN RESOURCES INC	87	87	336	37,850	金融
CSX CORP	208	222	772	86,851	資本財・サービス
FLUOR CORP	33	33	174	19,576	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	22	23.5	300	33,741	ヘルスケア
EXPEDIA INC	21.75	28.75	359	40,433	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	18.5	20	207	23,367	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	84	92.1	7,022	789,504	一般消費財・サービス
FLOWSERVE CORP	29	29	130	14,683	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	23	49	411	46,216	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	889.55	953.05	8,186	920,348	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	31	31	109	12,284	情報技術
AES CORP	143	156	185	20,834	公益事業
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	18	18	285	32,099	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	10	10	211	23,822	金融
EOG RESOURCES INC	116	126.5	1,169	131,460	エネルギー
EQT CORP	32	40.5	287	32,312	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	39	42	282	31,767	情報技術
AMERISOURCEBERGEN CORP	44	44	341	38,399	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	72.9	77.9	346	38,953	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	791.23	851.23	1,014	114,068	一般消費財・サービス
MACY'S INC	73.98	73.98	314	35,338	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	34.4	34.4	95	10,692	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	53.87	62.87	201	22,680	一般消費財・サービス
LIBERTY MEDIA CORP - A	21	—	—	—	その他
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	58.2	58.2	157	17,744	一般消費財・サービス
MOBILEYE NV	—	39	146	16,458	情報技術
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	—	3	31	3,556	ヘルスケア
AERCAP HOLDINGS NV	—	38	164	18,548	資本財・サービス
FORTINET INC	—	31	93	10,538	情報技術
MARKEL CORP	—	3.2	289	32,594	金融
NEXTERA ENERGY INC	95	105.5	1,237	139,085	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	223.08	271.08	405	45,620	素材
US BANCORP	379	395	1,939	218,032	金融
UNITED RENTALS INC	22	22	211	23,817	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	16	16	228	25,687	情報技術
FASTENAL CO	60	65	305	34,351	資本財・サービス
FISERV INC	50	52	554	62,281	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	1,994	2,056	6,383	717,675	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	33	36.5	148	16,704	一般消費財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		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	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	56	61.5	191	21,529	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	308	319	1,102	123,974	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	25	27.5	135	15,241	一般消費財・サービス
LINKEDIN CORP - A	23	26	507	57,005	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	60	60.5	1,059	119,113	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	83	83	1,757	197,580	金融
GAMESTOP CORP-CLASS A	23	—	—	—	一般消費財・サービス
ALPHABET INC-CL A	61.5	67.6	5,336	599,942	情報技術
ALPHABET INC-CL C	65.67	70.97	5,470	615,010	情報技術
GENERAL MILLS INC	126	136	852	95,801	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	87.68	99.68	324	36,475	公益事業
GENUINE PARTS CO	33	35	337	37,989	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	—	82.34	293	32,990	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	175	175	444	49,951	金融
MEDIVATION INC	34	—	—	—	その他
HARRIS CORP	25	29.5	308	34,715	情報技術
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	38	30	140	15,814	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	184	197.5	943	106,107	エネルギー
HOME DEPOT INC	275	281.5	3,648	410,198	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	16	14	120	13,546	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	178	246	302	33,960	金融
HERSHEY CO/THE	33	33	323	36,404	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	45	45	269	30,312	一般消費財・サービス
HUMANA INC	32	35	735	82,628	ヘルスケア
STARWOOD HOTELS & RESORTS	38	—	—	—	その他
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	68	672	75,566	情報技術
HELMERICH & PAYNE	23	26	175	19,750	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	18	19	291	32,731	ヘルスケア
HP INC	392	407	616	69,318	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	392	377	894	100,615	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	—	45	160	18,095	一般消費財・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	39	39	107	12,074	エネルギー
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	—	21	76	8,555	一般消費財・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	28	28	230	25,934	金融
HARMAN INTERNATIONAL	14	16	175	19,686	一般消費財・サービス
KRAFT HEINZ CO/THE	128.03	139.53	1,172	131,762	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	199	209.5	3,425	385,145	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	86	91	444	49,964	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	32	36	202	22,744	資本財・サービス
ZOETIS INC	103	107	539	60,686	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	57.29	60.29	452	50,874	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	47	47	183	20,590	エネルギー
LEGGETT & PLATT INC	31	31	150	16,926	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	134.23	145.23	451	50,759	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	—	24.37	52	5,895	一般消費財・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	—	41.05	315	35,511	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	75	82	219	24,686	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	24	27.2	346	38,916	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	591	624	7,018	789,048	ヘルスケア
ABBVIE INC	367.29	373.79	2,302	258,810	ヘルスケア
HOLOGIC INC	51	57.5	224	25,197	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	77	83.5	972	109,359	生活必需品
KROGER CO	200	212	701	78,887	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	33	37	302	33,975	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	57	61.5	1,639	184,308	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	17	21	314	35,339	情報技術
L BRANDS INC	53	56	402	45,296	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	203	205	1,449	162,958	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	211	227.5	1,527	171,739	ヘルスケア
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	65	69	387	43,570	電気通信サービス
LAM RESEARCH CORP	33	37	398	44,744	情報技術
RANGE RESOURCES CORP	37	43	156	17,581	エネルギー
JONES LANG LASALLE INC	9	10	101	11,382	不動産
LOEWS CORP	61	65	288	32,459	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	54.49	54.49	345	38,788	金融
MCDONALD'S CORP	205	194	2,341	263,196	一般消費財・サービス
3M CO	135	139	2,401	269,976	資本財・サービス
FACEBOOK INC-A	456	531.5	6,424	722,213	情報技術
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	—	52.54	279	31,464	情報技術
MANPOWERGROUP INC	17	17	144	16,267	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	58	61.5	735	82,696	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	12	14	305	34,389	素材
CONCHO RESOURCES INC	28	32.5	413	46,521	エネルギー
PHILLIPS 66	117	110	906	101,885	エネルギー
MURPHY OIL CORP	36	36	105	11,906	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	93	108	311	35,052	一般消費財・サービス
MATTEL INC	72	78	246	27,674	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	25	26.5	246	27,744	生活必需品
MYLAN NV	87	104.5	376	42,362	ヘルスケア
METLIFE INC	203	213.5	1,156	130,065	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	84	105	150	16,974	情報技術

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	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	34.28	36.78	298	33,537	情報技術
MONSANTO CO	102.06	100.56	1,029	115,751	素材
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	6	253	28,444	ヘルスケア
ROCKWELL AUTOMATION INC	28	29.5	387	43,557	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	598.21	638.71	3,972	446,547	ヘルスケア
MASCO CORP	74	74	238	26,795	資本財・サービス
M & T BANK CORP	32.19	33.69	474	53,323	金融
MARSH & MCLENNAN COS	115	121.5	838	94,219	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	47.82	75.22	595	66,897	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	22	26.5	222	25,039	情報技術
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	44	39.5	188	21,186	一般消費財・サービス
TOWERS WATSON & CO-CL A	15	—	—	—	その他
VANTIV INC - CL A	33	35.5	205	23,147	情報技術
FIREEYE INC	22	—	—	—	情報技術
REALOGY HOLDINGS CORP	32	—	—	—	不動産
NETAPP INC	67	67	244	27,499	情報技術
NIKE INC -CL B	146	305.5	1,546	173,885	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	65	67.5	704	79,199	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	45	48.5	320	36,001	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	27	30	213	23,979	金融
ALLY FINANCIAL INC	93	102	196	22,096	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	39	39.5	994	111,814	資本財・サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	62	62	393	44,217	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	115	120	402	45,260	素材
ADT CORP/THE	39.62	—	—	—	その他
MCKESSON CORP	49	51.5	727	81,778	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	60	64	254	28,599	情報技術
XYLEM INC	38	42	215	24,240	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	330	358.5	3,248	365,141	生活必需品
NUCOR CORP	68	71.5	440	49,538	素材
WESTERN UNION CO	113.46	113.46	240	26,989	情報技術
NEWELL BRANDS INC	60	101.42	481	54,123	一般消費財・サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	163	175.5	1,185	133,313	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP - C	45	—	—	—	その他
LIBERTY BROADBAND-C	—	26	186	20,995	一般消費財・サービス
PAYCHEX INC	68	75.5	448	50,467	情報技術
PATTERSON COS INC	19	19	73	8,302	ヘルスケア
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21	22	605	68,110	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	420	450.5	2,936	330,105	生活必需品
P G & E CORP	102	115	695	78,164	公益事業
PFIZER INC	1,313.63	1,396.63	4,458	501,173	ヘルスケア
ALKERMES PLC	32	36	209	23,501	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	106	115	465	52,346	公益事業
STRYKER CORP	72	78.5	905	101,848	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	29	30.5	417	46,957	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	32	37.5	651	73,214	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	14	14	121	13,642	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	577.37	581.67	4,821	542,028	生活必需品
EXELON CORP	187.22	213.22	717	80,683	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	48	51	640	72,006	ヘルスケア
CONOCOPHILLIPS	264	286.5	1,267	142,457	エネルギー
PEPSICO INC	314	327	3,353	376,950	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	97	102	1,017	114,404	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	38	40.5	307	34,593	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	134	145.5	1,759	197,822	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	22	22	136	15,301	金融
PENTAIR PLC	40.05	40.05	225	25,308	資本財・サービス
QUALCOMM INC	348	336.5	2,246	252,586	情報技術
PARTNERRE LTD	10	—	—	—	その他
INVESCO LTD	90.5	98.5	304	34,261	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	15.5	17	288	32,451	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	62	66	377	42,433	金融
ENERGEN CORP	17	—	—	—	エネルギー
RAYTHEON COMPANY	66	69	1,038	116,773	資本財・サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	18	18	126	14,177	一般消費財・サービス
RED HAT INC	39	42	336	37,773	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	16	18.1	700	78,799	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	53	56.5	315	35,506	資本財・サービス
PRICELINE GROUP INC/THE	11	11.4	1,733	194,835	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	88	94	644	72,461	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	21	21	179	20,218	素材
RESMED INC	30	32.5	201	22,692	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	31	33	292	32,925	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	28	28	125	14,061	資本財・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	184.78	196.78	1,081	121,582	生活必需品
RITE AID CORP	196	230	185	20,814	生活必需品
RALPH LAUREN CORP	13	13	141	15,872	一般消費財・サービス
AUTONATION INC	17	17	75	8,452	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	27	29	267	30,104	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	288.35	288.35	380	42,724	金融
CHEVRON CORP	400.18	433.18	4,736	532,464	エネルギー

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	
EDISON INTERNATIONAL	69	75	533	59,990	公益事業
TESLA MOTORS INC	20	26.7	506	56,901	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	147	147	357	40,190	情報技術
ENDO INTERNATIONAL PLC	43	46	74	8,362	ヘルスケア
STANLEY BLACK & DECKER INC	33.22	34.72	416	46,811	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	34	34	207	23,380	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	18	48.85	1,370	154,037	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	64	71	207	23,274	不動産
TWITTER INC	104	130	236	26,583	情報技術
NAVIENT CORP	87	87	149	16,812	金融
SANDISK CORP	44	—	—	—	その他
SOUTHERN CO/THE	196	217.5	1,050	118,124	公益事業
SYSCO CORP	125	124	668	75,123	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	68.23	67.23	764	85,934	金融
SOUTHWESTERN ENERGY CO	79	110	127	14,332	エネルギー
SEI INVESTMENTS COMPANY	32	32	151	17,059	金融
STERICYCLE INC	18	19.5	147	16,623	資本財・サービス
SCHLUMBERGER LTD	270.67	322.02	2,573	289,322	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	35	39	144	16,217	資本財・サービス
AT&T INC	1,304.91	1,414.91	5,586	627,985	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	38	38	179	20,180	資本財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	17	18.3	505	56,846	素材
SEMPRA ENERGY	50	54	546	61,477	公益事業
TIFFANY & CO	28	28	225	25,370	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	70	70	276	31,084	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	223	230	1,711	192,373	情報技術
SALESFORCE.COM INC	133	147	1,072	120,522	情報技術
SIGNET JEWELERS LTD	17	17	156	17,548	一般消費財・サービス
WESTROCK CO	55.3	59.3	301	33,925	素材
TIME WARNER CABLE	60.53	—	—	—	その他
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	89.25	217.84	988	111,133	資本財・サービス
TESORO CORP	28	28.5	234	26,323	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	188	189	1,900	213,684	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	143	190	284	31,932	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	118	123	565	63,579	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	181	182.5	1,986	223,303	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	150	159.5	1,854	208,501	資本財・サービス
UNUM GROUP	54	54	226	25,508	金融
SPRINT CORP	177.65	177.65	142	15,977	電気通信サービス
ANTERO RESOURCES CORP	—	34	84	9,475	エネルギー
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	19	34.94	282	31,788	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	50	50	189	21,264	金融
AMEREN CORPORATION	51	55	280	31,490	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	203.26	220.26	3,471	390,218	ヘルスケア
VERISIGN INC	22	22	174	19,568	情報技術
VALERO ENERGY CORP	108.92	107.92	688	77,368	エネルギー
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	13	13.9	361	40,692	一般消費財・サービス
FNF GROUP	52.38	57.38	187	21,035	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	20	20	246	27,695	ヘルスケア
ANTHEM INC	57	60.5	878	98,810	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	343	347	3,458	388,810	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	1,030.72	1,107.72	5,744	645,811	金融
FOOT LOCKER INC	29	32	231	26,059	一般消費財・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	96	103	725	81,506	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	151	167	483	54,313	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	29	31	231	26,050	一般消費財・サービス
WHITING PETROLEUM CORP	44	—	—	—	エネルギー
WHIRLPOOL CORP	17	17	278	31,262	一般消費財・サービス
WAL-MART STORES INC	343	351.5	2,508	282,023	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	37	46	475	53,471	ヘルスケア
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	168	195	84	9,470	エネルギー
WYNN RESORTS LTD	18	18	179	20,193	一般消費財・サービス
XEROX CORP	229.44	192.44	182	20,465	情報技術
WABTEC CORP	21	21	177	19,944	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	145	153.5	1,209	135,998	一般消費財・サービス
WATERS CORP	18	18	247	27,850	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	20	20	139	15,675	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	83.07	90.57	1,744	196,143	ヘルスケア
WHOLE FOODS MARKET INC	78	78	238	26,841	生活必需品
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	186	212.5	1,817	204,324	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	34	30.83	383	43,108	金融
WESTERN DIGITAL CORP	49	64.5	404	45,442	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	67.3	73.8	428	48,145	公益事業
WESTAR ENERGY INC	—	32	182	20,544	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	109	117.5	503	56,588	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	417	429.5	3,399	382,170	情報技術
PPL CORP	143	154	526	59,192	公益事業
PEPCO HOLDINGS INC	56	—	—	—	その他
PULTEGROUP INC	74	74	142	16,047	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	58	61.5	602	67,755	素材
NORTHERN TRUST CORP	49	49	397	44,696	金融

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		
PRECISION CASTPARTS CORP	30	—	—	—	その他
NVIDIA CORP	116.5	124	1,156	129,991	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	110.93	113.93	1,244	139,940	金融
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	95.5	95.5	205	23,093	一般消費財・サービス
TERADATA CORP	32	—	—	—	情報技術
TYSON FOODS INC-CL A	65	69	406	45,735	生活必需品
NETFLIX INC	86	98	1,151	129,462	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	85	90.5	1,278	143,728	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	71	—	—	—	公益事業
TORCHMARK CORP	26.75	26.75	186	20,951	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	31	34	277	31,163	金融
TEXTRON INC	59	63.5	291	32,823	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	266.5	249.5	710	79,854	一般消費財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	96	103	292	32,838	一般消費財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	83.37	83.37	96	10,815	一般消費財・サービス
OGE ENERGY CORP	42	47	151	17,045	公益事業
OMNICOM GROUP	53	55	485	54,621	一般消費財・サービス
ORACLE CORP	731.83	702.83	2,849	320,394	情報技術
MASTERCARD INC - A	214	224.5	2,330	262,023	情報技術
ONEOK INC	46	49	256	28,886	エネルギー
OCEANEERING INTL INC	21	—	—	—	エネルギー
CENTURYLINK INC	120.95	127.95	309	34,824	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	21	23	416	46,826	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	92	83	527	59,288	一般消費財・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	13	14	320	35,996	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	33	44	440	49,489	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	89	101	350	39,365	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	2,223.01	2,325.01	4,717	530,335	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	34	38	329	37,037	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	30	169	19,004	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	195	178	1,272	143,056	金融
ANALOG DEVICES INC	67	70	521	58,650	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	60	60	243	27,405	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	285.72	243.22	1,539	173,025	金融
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	14	14	160	18,009	素材
ANADARKO PETROLEUM CORP	109	127	764	85,892	エネルギー
SKYWORX SOLUTIONS INC	41	44	339	38,196	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	38	40.5	335	37,753	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	—	45	175	19,780	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	25	25	131	14,732	ヘルスケア
AVERY DENNISON CORP	19	21	153	17,222	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	131	141.5	787	88,493	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	141	148.5	807	90,817	資本財・サービス
AON PLC	60	62	704	79,214	金融
AMGEN INC	162	174	2,540	285,591	ヘルスケア
CORE LABORATORIES N. V.	10	10	106	11,933	エネルギー
COACH INC	59	64	239	26,908	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	100.86	104.36	685	77,068	資本財・サービス
CELGENE CORP	169	179	2,186	245,764	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	37	41.2	641	72,161	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	260	245	787	88,577	情報技術
CIT GROUP INC	39	45	180	20,316	金融
CIMAREX ENERGY CO	19	22.5	278	31,362	エネルギー
CME GROUP INC	69	78	878	98,797	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	82.44	88.44	306	34,400	エネルギー
ECOLAB INC	58	61.5	715	80,483	素材
EQUIFAX INC	26	27.5	328	36,888	資本財・サービス
GAP INC/THE	50	58	146	16,457	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	311	306	2,291	257,556	ヘルスケア
ST JUDE MEDICAL INC	59	64.5	514	57,791	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	41.48	43.98	393	44,226	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	32	68.5	242	27,314	生活必需品
STATE STREET CORP	89.43	91.93	707	79,588	金融
STAPLES INC	136	156	153	17,204	一般消費財・サービス
SUNTRUST BANKS INC	110.48	115.98	593	66,678	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	252	274	1,053	118,468	金融
IHS INC-CLASS A	15	—	—	—	その他
BAXTER INTERNATIONAL INC	116	114	510	57,363	ヘルスケア
B/E AEROSPACE INC	23	23	137	15,490	資本財・サービス
CAMPBELL SOUP CO	40	46	265	29,812	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	31	31	172	19,390	素材
CHUBB CORP	49	—	—	—	その他
CARDINAL HEALTH INC	71	75.5	535	60,254	ヘルスケア
FEDEX CORP	57	58.5	1,113	125,165	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	116.54	114.04	941	105,896	金融
FMC CORP	28	32	175	19,713	素材
FLEX LTD	122	122	177	19,941	情報技術
CERNER CORP	66	70	348	39,166	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	18	18	218	24,535	素材
CITRIX SYSTEMS INC	34	36.5	320	36,084	情報技術
INTEL CORP	1,004	1,084	3,827	430,299	情報技術

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	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	41	—	—	—	その他
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	88	88	214	24,079	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	92	91	426	48,000	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	70	74	929	104,495	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	553	450	207	23,321	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC	30	33.5	457	51,418	ヘルスケア
CHESAPEAKE ENERGY CORP	119	—	—	—	エネルギー
SEALED AIR CORP	44	44	206	23,243	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	8	8.7	565	63,603	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	—	31	252	28,434	情報技術
SNAP-ON INC	12	13	218	24,524	資本財・サービス
CALPINE CORP	72	72	83	9,332	公益事業
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	43	—	—	—	その他
CARMAX INC	46	46	264	29,740	一般消費財・サービス
COMERICA INC	40	40	247	27,767	金融
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	23	—	—	—	資本財・サービス
INGREDION INC	—	16	192	21,624	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	148.28	158.28	1,208	135,891	公益事業
TARGET CORP	130	129	1,011	113,711	一般消費財・サービス
DOVER CORP	35	35	244	27,456	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	13	13	294	33,080	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	26	29	178	20,121	資本財・サービス
JOHNSON CONTROLS INC	142	—	—	—	その他
CINTAS CORP	21	21	242	27,286	資本財・サービス
CA INC	71.05	71.05	230	25,943	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	90	95	358	40,284	生活必需品
CLOROX COMPANY	28	29.5	347	39,030	生活必需品
ENTERGY CORP	38	42.5	303	34,113	公益事業
MICROSOFT CORP	1,614	1,693.5	10,345	1,163,051	情報技術
INCYTE CORP	34	38.5	404	45,476	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	239.74	247.24	1,876	210,906	生活必需品
MEDTRONIC PLC	301.88	316.38	2,322	261,136	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	230	241	468	52,615	情報技術
BLACKROCK INC	26	28.5	1,050	118,082	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	91	91	219	24,644	公益事業
HASBRO INC	24	26	225	25,318	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	56	61	449	50,485	生活必需品
KEYCORP	184	245	416	46,850	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	24	24	211	23,729	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	347.11	356.11	1,526	171,585	生活必需品
KOHL'S CORP	44	44	238	26,780	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	10	11	187	21,041	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	100	111	176	19,878	金融
APACHE CORP	81.1	87.6	532	59,816	エネルギー
CHUBB LTD	70	107.99	1,384	155,686	金融
ARROW ELECTRONICS INC	20	20	136	15,379	情報技術
ALLSTATE CORP	89	87	605	68,101	金融
EBAY INC	237	250	712	80,127	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC	234	249.5	995	111,886	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	32	35	257	28,994	素材
XILINX INC	56	59.5	321	36,127	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	155.1	143.1	1,099	123,647	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP-A	47	53	305	34,373	一般消費財・サービス
YAHOO! INC	193	210	873	98,210	情報技術
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	49	51.5	404	45,512	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	38	38	116	13,076	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	54	59	167	18,797	情報技術
LINEAR TECHNOLOGY CORP	53	56	350	39,391	情報技術
LENNAR CORP-A	39	44	194	21,883	一般消費財・サービス
LEAR CORP	17	17	217	24,474	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	57	65	221	24,895	金融
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	83	—	—	—	資本財・サービス
PROGRESSIVE CORP	128	134	449	50,585	金融
PRAXAIR INC	62	66	806	90,654	素材
PACCAR INC	76.37	79.87	489	55,014	資本財・サービス
PVH CORP	17	19	201	22,647	一般消費財・サービス
EMC CORP/MA	411	—	—	—	その他
BIOGEN INC	50.3	50.8	1,538	172,910	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	—	20	240	27,057	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	321	336	1,954	219,726	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC	31	34	291	32,791	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	66.8	74.8	402	45,198	公益事業
INTUIT INC	57	56	650	73,128	情報技術
BORGWARNER INC	48	48	165	18,595	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	65	71	323	36,413	一般消費財・サービス
BALL CORP	28	37.92	292	32,846	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	288.47	310.47	644	72,493	ヘルスケア
BED BATH & BEYOND INC	36	36	162	18,236	一般消費財・サービス
XL GROUP LTD	63	68	248	27,894	金融
ELECTRONIC ARTS INC	68	70.5	573	64,490	情報技術
VULCAN MATERIALS CO	29	30.5	384	43,247	素材

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		
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	52	56.5	483	54,402	ヘルスケア	
VF CORP	71	77.5	431	48,467	一般消費財・サービス	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	94.71	94.71	577	64,948	一般消費財・サービス	
VIACOM INC-CLASS B	72.71	81.71	301	33,941	一般消費財・サービス	
MOHAWK INDUSTRIES INC	13	15	300	33,742	一般消費財・サービス	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	60	52	84	9,540	情報技術	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	22	22	200	22,595	ヘルスケア	
CARNIVAL CORP	87	80.5	428	48,163	一般消費財・サービス	
COMCAST CORP-CLASS A	452.7	545.7	3,827	430,292	一般消費財・サービス	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	84	—	—	—	その他	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	—	58	311	35,059	資本財・サービス	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	265	166	18,679	不動産	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	67,034.73	71,134.09	445,578	50,091,912	
	銘柄数 < 比率 >	585銘柄	584銘柄		<63.4%>	
		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)						
IMPERIAL OIL LTD	66	72	318	26,642	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4	4.4	277	23,247	情報技術	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	30	46.96	142	11,965	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	43.87	53.87	350	29,296	一般消費財・サービス	
SILVER WHEATON CORP	90	107	268	22,473	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	29	31.5	292	24,461	金融	
BCE INC	34.3	34.3	200	16,793	電気通信サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	35	43	342	28,623	素材	
SUNCOR ENERGY INC	318.8	393.3	1,586	132,797	エネルギー	
METRO INC	55	55	225	18,892	生活必需品	
NATIONAL BANK OF CANADA	70	77	386	32,307	金融	
BANK OF NOVA SCOTIA	266	282	2,078	173,915	金融	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	87	91.5	969	81,168	金融	
TORONTO-DOMINION BANK	404	437	2,800	234,365	金融	
GREAT-WEST LIFECO INC	67	67	238	19,970	金融	
MEG ENERGY CORP	38	—	—	—	エネルギー	
ROYAL BANK OF CANADA	315	348.5	3,140	262,812	金融	
TOURMALINE OIL CORP	38	47	164	13,737	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	25	25	128	10,725	エネルギー	
TRANSCANADA CORP	154	189.5	1,145	95,873	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	75	94	361	30,275	エネルギー	
BOMBARDIER INC-B	366	454	86	7,218	資本財・サービス	
BARRICK GOLD CORP	245	273	566	47,402	素材	
CAE INC	74	58	114	9,604	資本財・サービス	
THOMSON REUTERS CORP	78.04	78.04	454	38,046	金融	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	178	202	476	39,858	素材	
EMPIRE CO LTD 'A'	39	39	71	5,991	生活必需品	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	14	14	67	5,664	素材	
VERESEN INC	62	80	95	8,013	エネルギー	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	6.9	162	13,565	素材	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	—	97	109	9,131	金融	
LINAMAR CORP	—	11	56	4,703	一般消費財・サービス	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	—	54	156	13,104	エネルギー	
HYDRO ONE LTD	—	40	92	7,755	公益事業	
LOBLAW COMPANIES LTD	48.6	51.6	360	30,186	生活必需品	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	28	28	99	8,336	公益事業	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	81	86	451	37,795	電気通信サービス	
AGNICO EAGLE MINES LTD	48	51	287	24,056	素材	
KINROSS GOLD CORP	295	295	133	11,157	素材	
BANK OF MONTREAL	143	152	1,354	113,380	金融	
POWER CORP OF CANADA	80	87	260	21,833	金融	
METHANEX CORP	22	22	120	10,066	素材	
CAMECO CORP	92	92	112	9,392	エネルギー	
TELUS CORP	54	54	229	19,163	電気通信サービス	
POWER FINANCIAL CORP	56	56	188	15,782	金融	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	121	134	453	37,933	素材	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	17	17	241	20,216	一般消費財・サービス	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	208	208	95	8,023	素材	
AGRIUM INC	29	31	409	34,231	素材	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	243	255	1,062	88,917	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4.5	5.4	343	28,784	金融	
MAGNA INTERNATIONAL INC	89	93	508	42,545	一般消費財・サービス	
WESTON (GEORGE) LTD	11	11	123	10,314	生活必需品	
BLACKBERRY LTD	119	119	119	9,957	情報技術	
SUN LIFE FINANCIAL INC	132	142.5	732	61,327	金融	
ENBRIDGE INC	189	220	1,247	104,364	エネルギー	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	190	205.5	928	77,709	金融	
MANULIFE FINANCIAL CORP	425	469	1,082	90,618	金融	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	71	71	163	13,694	ヘルスケア	
GOLDCORP INC	177.59	199.59	360	30,146	素材	
ENCANA CORP	184	232	352	29,528	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	34	34	680	56,956	資本財・サービス	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	28	22	122	10,289	金融	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	52	52	193	16,217	一般消費財・サービス	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	176	183.5	1,647	137,844	資本財・サービス	

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		
CGI GROUP INC - CLASS A	49	53	347	29,049	情報技術	
HUSKY ENERGY INC	74	75.58	111	9,297	エネルギー	
ONEX CORPORATION	20	20	189	15,835	金融	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	87	95	252	21,098	一般消費財・サービス	
FINNING INTERNATIONAL INC	39	39	101	8,485	資本財・サービス	
SNC-LAVALIN GROUP INC	34	34	190	15,981	資本財・サービス	
ELDORADO GOLD CORP	172	172	62	5,224	素材	
IGM FINANCIAL INC	23	23	86	7,236	金融	
OPEN TEXT CORP	28	28	238	19,955	情報技術	
CI FINANCIAL CORP	48	54	144	12,069	金融	
SAPUTO INC	58	58	270	22,670	生活必需品	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	147	171	249	20,891	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	90	98	629	52,672	生活必需品	
YAMANA GOLD INC	201	233	93	7,818	素材	
YAMANA GOLD INC-RTS	—	14.56	0	40	その他	
FORTIS INC	61	96	392	32,880	公益事業	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	105	133	202	16,916	エネルギー	
CENOVUS ENERGY INC	183	196	371	31,096	エネルギー	
DOLLARAMA INC	27	27	278	23,303	一般消費財・サービス	
ATCO LTD -CLASS I	—	17	73	6,131	公益事業	
ALTAGAS LTD	31	39	125	10,469	エネルギー	
FIRST CAPITAL REALTY INC	—	26	52	4,394	不動産	
KEYERA CORP	40	40	149	12,481	エネルギー	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	34	39	126	10,560	エネルギー	
INTER PIPELINE LTD	74	81	219	18,409	エネルギー	
CANADIAN OIL SANDS LTD	112	—	—	—	その他	
ARC RESOURCES LTD	75	83	184	15,453	エネルギー	
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,560.7 84銘柄	9,531 90銘柄	37,543 <4.0%>	3,141,605	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD	—	375	86	7,257	ヘルスケア	
MEDIBANK PRIVATE LTD	545	617	160	13,497	金融	
BHP BILLITON LIMITED	702	752	1,914	161,093	素材	
SOUTH32 LTD	1,182	1,272	356	29,967	素材	
LENLEASE GROUP	121	121	164	13,856	不動産	
ASCIANO LTD	216	—	—	—	その他	
ALUMINA LTD	699	699	118	9,968	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	161	182	552	46,461	エネルギー	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	397	397	246	20,710	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	118	118	141	11,934	金融	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	570	620	1,783	150,031	金融	
WESTPAC BANKING CORP	679.98	780.98	2,436	205,020	金融	
SANTOS LTD	220	340	137	11,586	エネルギー	
AUSNET SERVICES	—	410	60	5,122	公益事業	
AUST AND NZ BANKING GROUP	602	689	1,935	162,844	金融	
RIO TINTO LTD	97	97	585	49,287	素材	
ORIGIN ENERGY LTD	364	414	250	21,039	エネルギー	
AMCOR LIMITED	267	267	387	32,597	素材	
AURIZON HOLDINGS LTD	468	468	235	19,846	資本財・サービス	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	—	100	43	3,660	電気通信サービス	
OIL SEARCH LTD	—	329	217	18,325	エネルギー	
SEEK LTD	75	75	110	9,320	資本財・サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD	146	171	185	15,639	生活必需品	
NEWCREST MINING LTD	176	176	343	28,862	素材	
INCITEC PIVOT LTD	456	456	147	12,392	素材	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	370	401	3,118	262,363	金融	
CALTEX AUSTRALIA LTD	60	60	179	15,119	エネルギー	
ORICA LTD	83	83	145	12,200	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	306	328	364	30,633	金融	
CIMIC GROUP LTD	29	29	90	7,630	資本財・サービス	
WOOLWORTHS LTD	281	300	691	58,182	生活必需品	
COCA-COLA AMATIL LTD	137	137	131	11,100	生活必需品	
TABCORP HOLDINGS LTD	205	205	96	8,089	一般消費財・サービス	
CROWN RESORTS LTD	106	106	122	10,328	一般消費財・サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	145.54	145.54	46	3,894	資本財・サービス	
TELSTRA CORP LTD	936	986	496	41,812	電気通信サービス	
AMP LTD	665	665	315	26,577	金融	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	114	114	237	19,970	素材	
MACQUARIE GROUP LTD	64.84	72.84	605	50,942	金融	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	126	187	15,754	一般消費財・サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	—	91	102	8,598	金融	
CSL LTD	103	106	1,048	88,198	ヘルスケア	
WESFARMERS LTD	244.45	267.45	1,124	94,626	生活必需品	
COCHLEAR LTD	17	14	165	13,958	ヘルスケア	
SUNCORP GROUP LTD	287	312	389	32,762	金融	
BORAL LTD	227	227	113	9,588	素材	
BORAL LTD-RTS	—	102.25	2	219	その他	
ASX LTD	42	42	203	17,139	金融	
COMPUTERSHARE LTD	139	139	163	13,718	情報技術	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	140	65	5,536	一般消費財・サービス	

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	千オーストラリア・ドル	千円		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	511	549	309	26,006	金融	
SONIC HEALTHCARE LTD	95	95	206	17,393	ヘルスケア	
TRANSURBAN GROUP	424	478	499	42,028	資本財・サービス	
TRANSURBAN GROUP-RIGHTS	23.55	—	—	—	その他	
ILUKA RESOURCES LTD	120	—	—	—	素材	
CHALLENGER LTD	—	122	130	11,014	金融	
SYDNEY AIRPORT	251	251	156	13,199	資本財・サービス	
TATTS GROUP LTD	369	369	155	13,071	一般消費財・サービス	
AGL ENERGY LTD	152	152	318	26,793	公益事業	
BRAMBLES LTD	349	373	444	37,409	資本財・サービス	
APA GROUP	242	267	213	17,927	公益事業	
DUET GROUP	—	500	119	10,012	公益事業	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	29	33	236	19,908	ヘルスケア	
TPG TELECOM LTD	—	65	45	3,828	電気通信サービス	
REA GROUP LTD	—	12	61	5,214	一般消費財・サービス	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	14	95	8,034	一般消費財・サービス	
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	15,529.36 54銘柄	18,405.06 63銘柄	25,803	2,171,113 <2.7%>	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	300	330	2,413	35,002	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	520	550	2,068	29,986	一般消費財・サービス	
MTR CORP	320	345	1,338	19,409	資本財・サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	380	350	3,514	50,953	不動産	
SINO LAND CO	880	880	1,022	14,827	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	586.69	631.69	5,963	86,465	資本財・サービス	
WHARF HOLDINGS LTD	290	320	1,760	25,520	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	125	125	963	13,974	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	410	425	3,240	46,989	公益事業	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	330	330	343	4,985	資本財・サービス	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	258.06	283.86	1,216	17,636	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	1,494.93	1,811.42	2,626	38,085	公益事業	
HANG SENG BANK LTD	168	179	2,620	37,998	金融	
WHEELOCK & CO LTD	250	250	1,076	15,605	不動産	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,130	1,290	1,104	16,011	不動産	
WH GROUP LTD	—	1,350	854	12,390	生活必需品	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	245	273	5,558	80,595	金融	
LI & FUNG LTD	1,320	1,320	447	6,488	一般消費財・サービス	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	520	520	895	12,983	不動産	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	65	65	487	7,068	情報技術	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	210	210	582	8,449	一般消費財・サービス	
NWS HOLDINGS LTD	465	465	641	9,304	資本財・サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	180	180	376	5,454	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	290.4	290.4	939	13,621	金融	
HYSAN DEVELOPMENT CO	—	140	469	6,800	不動産	
SJM HOLDINGS LTD	470	470	289	4,204	一般消費財・サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	300	300	676	9,809	不動産	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	596.69	641.69	3,333	48,336	不動産	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	150	150	979	14,202	公益事業	
PCCW LTD	—	950	424	6,157	電気通信サービス	
AIA GROUP LTD	2,628	2,830	13,315	193,069	金融	
SANDS CHINA LTD	540	572	2,225	32,263	一般消費財・サービス	
SHANGRI-LA ASIA LTD	300	300	257	3,736	一般消費財・サービス	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	315	315	937	13,588	一般消費財・サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	200	200	340	4,930	一般消費財・サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	825	875	2,537	36,793	金融	
WYNN MACAU LTD	380	380	529	7,680	一般消費財・サービス	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	570	570	566	8,215	電気通信サービス	
香港ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	18,012.77 35銘柄	21,468.06 38銘柄	68,937	999,599 <1.3%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
UNITED OVERSEAS BANK LTD	290	300	602	47,571	金融	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	385	415	720	56,860	金融	
SINGAPORE AIRLINES LTD	124.7	124.7	122	9,709	資本財・サービス	
KEPPEL CORP LTD	315	345	185	14,684	資本財・サービス	
UOL GROUP LTD	132	132	76	6,045	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	112	112	92	7,323	不動産	
CAPITALAND LTD	590	590	178	14,117	不動産	
SEMBCORP MARINE LTD	250	—	—	—	資本財・サービス	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	410	410	152	12,044	一般消費財・サービス	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30	30	118	9,369	一般消費財・サービス	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	670	742	669	52,853	金融	
GENTING SINGAPORE PLC	1,530	1,530	147	11,659	一般消費財・サービス	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,750.5	1,886.5	711	56,164	電気通信サービス	
NOBLE GROUP LTD	1,151.81	—	—	—	資本財・サービス	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	350	350	115	9,148	資本財・サービス	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	290	290	79	6,252	資本財・サービス	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	2,194	2,194	95	7,536	生活必需品	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	190	190	136	10,773	金融	
COMFORTDELGRO CORP LTD	468	468	117	9,239	資本財・サービス	

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	評価額	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
STARHUB LTD	百株 —	百株 160	千シンガポール・ドル 45	千円 3,626	電気通信サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	560	560	199	15,743	生活必需品
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	690	690	140	11,115	不動産
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,483.01 21銘柄	11,519.2 20銘柄	4,708 <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	—	260	66	5,362	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	526.89	526.89	184	14,841	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	234	234	142	11,454	資本財・サービス
CONTACT ENERGY LTD	130	130	61	4,934	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	201	201	217	17,420	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	—	53	45	3,632	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,091.89 4銘柄	1,404.89 6銘柄	718 <0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT	141	163	71	10,057	一般消費財・サービス
TUI AG-DI	107.47	117.47	123	17,374	一般消費財・サービス
BP PLC	3,979	4,363	1,930	271,206	エネルギー
UNILEVER PLC	277.6	301.1	942	132,375	生活必需品
BARCLAYS PLC	3,657	3,975	851	119,621	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	394	434	292	41,025	資本財・サービス
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL	36,523.8	—	—	—	その他
MARKS & SPENCER GROUP PLC	353	381	125	17,569	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	19	23	134	18,882	素材
REXAM PLC	151.6	—	—	—	その他
PRUDENTIAL PLC	563	602	930	130,767	金融
INMARSAT PLC	94	103	74	10,438	電気通信サービス
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	681.91	792.91	156	21,940	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	44.09	45.64	143	20,135	素材
BAE SYSTEMS PLC	677	761	457	64,294	資本財・サービス
AVIVA PLC	883.66	939.66	424	59,617	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,061.02	1,150.02	1,734	243,589	ヘルスケア
MELROSE INDUSTRIES PLC	240.42	—	—	—	資本財・サービス
WORLDPAY GROUP PLC	—	427	115	16,283	情報技術
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	80	56	7,893	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	—	252	101	14,264	情報技術
DCC PLC	—	20	122	17,136	資本財・サービス
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	—	19,964	1	280	その他
ROYAL MAIL PLC	171	224	104	14,617	資本財・サービス
RELX PLC	247.46	256.46	353	49,674	資本財・サービス
BG GROUP PLC	744	—	—	—	その他
DIAGEO PLC	549	594	1,194	167,825	生活必需品
RIO TINTO PLC	276	291.5	894	125,575	素材
STANDARD CHARTERED PLC	557	783	494	69,430	金融
TESCO PLC	1,753	1,911	399	56,059	生活必需品
FRESNILLO PLC	50	50	61	8,666	素材
SMITH & NEPHEW PLC	193	215	242	34,064	ヘルスケア
GLENCORE PLC	2,369.25	2,909.25	818	114,968	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	57	57	67	9,503	金融
SMITHS GROUP PLC	84.33	93.33	130	18,352	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	61	61	57	8,118	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	298.83	339.83	119	16,806	金融
DIXONS CARPHONE PLC	209	248	83	11,683	一般消費財・サービス
PEARSON PLC	173.63	188.63	146	20,626	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	285.25	381.25	88	12,487	生活必需品
NEXT PLC	31	33	162	22,893	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	689	739	110	15,507	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	40.11	43.11	150	21,084	一般消費財・サービス
IMI PLC	58.5	58.5	56	7,871	資本財・サービス
BUNZL PLC	72.55	77.55	159	22,438	資本財・サービス
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	206	206	55	7,748	金融
GKN PLC	365	406	125	17,587	一般消費財・サービス
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	55	—	—	—	一般消費財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	5,773.83	6,261.83	1,216	170,849	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	31	29.93	98	13,797	素材
KINGFISHER PLC	519.11	519.11	185	26,066	一般消費財・サービス
WPP PLC	282	298	512	71,994	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	147.27	159.27	143	20,201	公益事業
SEVERN TRENT PLC	51.33	57.33	127	17,884	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	139	149	1,007	141,539	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	110	119	112	15,828	金融
SCHROEDERS PLC	27	32	89	12,531	金融
TATE & LYLE PLC	101	101	69	9,703	生活必需品
AMEC FOSTER WHEELER PLC	86	—	—	—	エネルギー
SSE PLC	214	238	355	49,876	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	48	48	83	11,717	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	212	227	108	15,180	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	276	298	1,265	177,725	ヘルスケア
WOLSELEY PLC	56.15	59.65	275	38,708	資本財・サービス

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	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,306	1,436	343	48,186	金融
3I GROUP PLC	210.91	229.91	154	21,717	金融
SKY PLC	222	248	192	26,978	一般消費財・サービス
ASHTED GROUP PLC	112	122	184	25,892	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	241.14	261.14	176	24,777	情報技術
NATIONAL GRID PLC	813.28	888.28	824	115,797	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	12,469.65	15,039.65	867	121,910	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	217.6	242.6	130	18,349	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	207	226.5	796	111,922	生活必需品
CENTRICA PLC	1,071.6	1,283.6	269	37,825	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	—	30	75	10,606	一般消費財・サービス
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	36.5	108	15,200	金融
ARM HOLDINGS PLC	305	—	—	—	その他
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	406.6	435.6	1,940	272,545	生活必需品
ICAP PLC	120	120	58	8,191	金融
SABMILLER PLC	210	—	—	—	その他
BHP BILLITON PLC	455.77	501.77	659	92,573	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	77	85	217	30,528	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	4,255	4,633	2,927	411,144	金融
SHIRE PLC	128	210.74	994	139,744	ヘルスケア
OLD MUTUAL PLC	1,040.25	1,170.25	221	31,148	金融
ANGLO AMERICAN PLC	298.83	334.83	403	56,647	素材
MONDI PLC	75	83	135	19,037	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	509	509	112	15,743	生活必需品
CARNIVAL PLC	41.61	45.11	186	26,161	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	35	35	35	4,970	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	366.41	388.41	540	75,942	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	68	75.5	130	18,282	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	1,826	2,000	708	99,544	電気通信サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	44	44	73	10,351	生活必需品
WILLIAM HILL PLC	192	192	58	8,147	一般消費財・サービス
BURBERRY GROUP PLC	95.89	104.89	147	20,743	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	50.73	44.77	148	20,915	一般消費財・サービス
AGGREKO PLC	54.68	—	—	—	資本財・サービス
CAPITA PLC	142.9	150.9	84	11,816	資本財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC	53	59	80	11,353	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	35	38	123	17,346	資本財・サービス
ITV PLC	825	868	148	20,872	一般消費財・サービス
PETROFAC LTD	56	56	43	6,056	エネルギー
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	66.49	75.49	209	29,434	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	849	1,000	1,949	273,756	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	533.81	881.18	1,790	251,439	エネルギー
MEGGITT PLC	177	177	83	11,719	資本財・サービス
G4S PLC	346	346	82	11,654	資本財・サービス
COBHAM PLC	256	386	63	8,935	資本財・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	33	55	7,736	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	46	52	98	13,870	金融
INVESTEC PLC	123	145	75	10,621	金融
ANTOFAGASTA PLC	86	86	60	8,455	素材
STANDARD LIFE PLC	424.63	454.63	158	22,209	金融
EXPERIAN PLC	209.54	230.54	345	48,572	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	99,273.49 89,754.12	107銘柄 106銘柄	39,793 5,589,335	<7.1%>
(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	164	4,829	不動産
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	564	564	398	11,681	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD	140	140	201	5,910	素材
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	189	—	—	—	ヘルスケア
BANK HAPOALIM BM	265	265	613	17,987	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	376	376	583	17,120	金融
NICE LTD	17	17	430	12,615	情報技術
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,551 6銘柄	1,372 6銘柄	2,392 70,144	<0.1%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
DUFREY AG-REG	9	10.5	130	14,501	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	802	860	1,357	150,880	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	—	2	101	11,288	素材
ADECCO GROUP AG-REG	37	40	250	27,777	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	153.5	165	3,735	415,062	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	8	8	51	5,671	金融
SIKA AG-BR	0.54	0.54	263	29,327	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.02	117	13,015	生活必需品
ABB LTD-REG	483	439	907	100,871	資本財・サービス
ARYZTA AG	21	21	92	10,259	生活必需品
TRANSOCEAN LTD	84.5	—	—	—	エネルギー
SWISS RE AG	78	78	726	80,685	金融
NESTLE SA-REG	699.5	727	4,965	551,706	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3.5	4.2	209	23,251	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	10	179	19,966	資本財・サービス

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	千スイス・フラン	千円			
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	341.2	435.2	585	65,085	金融		
JULIUS BAER GROUP LTD	52	52	231	25,716	金融		
SULZER AG-REG	6.5	—	—	—	資本財・サービス		
SGS SA-REG	1.3	1.3	262	29,220	資本財・サービス		
SCHINDLER HOLDING AG-REG	—	5	88	9,838	資本財・サービス		
GALENICA AG-REG	—	0.9	95	10,619	ヘルスケア		
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7	7.5	221	24,649	一般消費財・サービス		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	33.32	35.12	930	103,407	金融		
BALOISE HOLDING AG - REG	12	12	149	16,573	金融		
NOVARTIS AG-REG	496.5	522	3,656	406,285	ヘルスケア		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	—	0.5	60	6,744	生活必需品		
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	114.5	123.5	805	89,467	一般消費財・サービス		
SWISSCOM AG-REG	5.5	5.9	255	28,418	電気通信サービス		
GEBERIT AG-REG	8	9	360	40,069	資本財・サービス		
GIVAUDAN-REG	2.1	2.2	400	44,488	素材		
ACTELION LTD-REG	23	22.5	470	52,249	ヘルスケア		
SYNGENTA AG-REG	20.12	21.62	829	92,220	素材		
SONOVA HOLDING AG-REG	13	13	160	17,795	ヘルスケア		
LONZA GROUP AG-REG	13	13	234	26,100	ヘルスケア		
SWATCH GROUP AG/THE-REG	11	11	63	7,070	一般消費財・サービス		
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	95.4	108.4	569	63,292	素材		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	8	8	224	24,897	金融		
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	12.5	12.5	165	18,374	資本財・サービス		
SWISS PRIME SITE-REG	14	16	133	14,870	不動産		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	—	0.23	116	12,994	生活必需品		
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,679.5 35銘柄	3,803.63 38銘柄	24,162	2,684,721		<3.4%>
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円			
NOVO NORDISK A/S-B	428	450	10,354	166,603	ヘルスケア		
DANSKE BANK A/S	152.5	163.5	3,368	54,192	金融		
ISS A/S	—	39	947	15,242	資本財・サービス		
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.95	0.95	842	13,550	資本財・サービス		
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52	52	2,445	39,340	資本財・サービス		
TDC A/S	193	193	690	11,117	電気通信サービス		
CARLSBERG AS-B	24.5	24.5	1,460	23,494	生活必需品		
NOVOZYMES A/S-B SHARES	55	55	1,310	21,088	素材		
COLOPLAST-B	25	28	1,236	19,890	ヘルスケア		
DSV A/S	42	46	1,444	23,247	資本財・サービス		
WILLIAM DEMANT HOLDING	6.75	33.75	391	6,299	ヘルスケア		
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1.6	1.6	1,496	24,083	資本財・サービス		
PANDORA A/S	25	26.5	2,232	35,922	一般消費財・サービス		
CHR HANSEN HOLDING A/S	—	23.5	933	15,026	素材		
GENMAB A/S	—	13	1,608	25,874	ヘルスケア		
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,006.3 12銘柄	1,150.3 15銘柄	30,762	494,974		<0.6%>
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円			
NORSK HYDRO ASA	299	334	1,352	17,828	素材		
DNB ASA	211.5	225.5	2,753	36,289	金融		
ORKLA ASA	190.5	190.5	1,458	19,220	生活必需品		
TELENOR ASA	158	178	2,255	29,724	電気通信サービス		
STATOIL ASA	241.73	261.73	3,656	48,190	エネルギー		
SCHIBSTED ASA-CL A	—	15	275	3,635	一般消費財・サービス		
YARA INTERNATIONAL ASA	37.6	41.6	1,321	17,419	素材		
MARINE HARVEST	—	87	1,345	17,738	生活必需品		
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	39.5	48.5	671	8,853	金融		
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	18	315	4,163	一般消費財・サービス		
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,177.83 7銘柄	1,399.83 10銘柄	15,406	203,063		<0.3%>
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円			
ICA GRUPPEN AB	13	19	518	6,356	生活必需品		
ERICSSON LM-B SHS	655.3	722.3	3,406	41,727	情報技術		
VOLVO AB-B SHS	324	345	3,372	41,311	資本財・サービス		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	15	15	587	7,195	電気通信サービス		
SKF AB-B SHARES	86.5	86.5	1,403	17,197	資本財・サービス		
ELECTROLUX AB-SER B	54.5	54.5	1,167	14,300	一般消費財・サービス		
NORDEA BANK AB	654.5	706.5	6,743	82,608	金融		
SWEDISH MATCH AB	45.5	45.5	1,322	16,197	生活必需品		
TELE2 AB-B SHS	89.5	89.5	627	7,685	電気通信サービス		
GETINGE AB-B SHS	47	47	677	8,296	ヘルスケア		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	320.5	341.5	3,114	38,152	金融		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	321	352	4,403	53,943	金融		
SWEDBANK AB - A SHARES	199	213	4,498	55,107	金融		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	208	217	5,815	71,241	一般消費財・サービス		
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	124	141	3,443	42,179	生活必需品		
SKANSKA AB-B SHS	82.5	82.5	1,723	21,111	資本財・サービス		
SANDVIK AB	223.5	244.5	2,650	32,467	資本財・サービス		
INVESTOR AB-B SHS	101	108	3,333	40,841	金融		
ATLAS COPCO AB-A SHS	144	157	4,322	52,947	資本財・サービス		
SECURITAS AB-B SHS	92	92	1,213	14,865	資本財・サービス		

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
TELIA CO AB	558	600	2,080	25,489	電気通信サービス	
ALFA LAVAL AB	70	70	967	11,850	資本財・サービス	
ATLAS COPCO AB-B SHS	83	91	2,224	27,255	資本財・サービス	
ASSA ABLOY AB-B	211	233	3,961	48,522	資本財・サービス	
LUNDIN PETROLEUM AB	64	64	1,054	12,920	エネルギー	
BOLIDEN AB	60	60	1,426	17,478	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	125.5	125.5	852	10,446	一般消費財・サービス	
KINNEVIK AB - B	53	53	1,187	14,549	金融	
HEXAGON AB-B SHS	55.5	62	1,957	23,985	情報技術	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	—	35	559	6,851	金融	
スウェーデン・クローネ通貨計	5,080.3	5,472.8	70,619	865,083		
	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	29銘柄	30銘柄	<1.1% >		
ユーロ (アイルランド)						
BANK OF IRELAND	6,618	6,618	132	15,843	金融	
KERRY GROUP PLC-A	34	38.5	256	30,692	生活必需品	
CRH PLC	175	194	604	72,347	素材	
PADDY POWER BETFAIR PLC	—	19	191	22,924	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3銘柄	4銘柄	1,184	141,808	<0.2% >
ユーロ (オランダ)						
QIAGEN N. V.	48.5	54.5	140	16,863	ヘルスケア	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	204.76	218.76	602	72,075	資本財・サービス	
NN GROUP NV	48	76	230	27,600	金融	
UNILEVER NV-CVA	351.5	383.5	1,419	169,963	生活必需品	
HEINEKEN NV	51	53	376	45,119	生活必需品	
RELX NV	214.19	234.19	358	42,889	資本財・サービス	
AEGON NV	407.44	407.44	193	23,209	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	192.93	298.83	565	67,676	生活必需品	
AKZO NOBEL	55	58	339	40,621	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	38	44	251	30,047	素材	
WOLTERS KLUWER	69	69	233	27,949	資本財・サービス	
BOSKALIS WESTMINSTER	21	21	61	7,337	資本財・サービス	
ING GROEP NV	847.5	918.5	1,159	138,804	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	684.5	782.5	212	25,383	電気通信サービス	
ASML HOLDING NV	74.3	86.8	846	101,354	情報技術	
TNT EXPRESS NV	101.95	—	—	—	その他	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	—	54	107	12,817	金融	
VOPAK	20	16	69	8,285	エネルギー	
RANDSTAD HOLDING NV	26.5	30	144	17,272	資本財・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	23	23	152	18,225	生活必需品	
GEMALTO	17	20	97	11,718	情報技術	
OCI NV	23	—	—	—	素材	
ALTICE NV - A	57	89	142	17,055	一般消費財・サービス	
ALTICE NV - B	19	29	46	5,581	一般消費財・サービス	
AIRBUS GROUP SE	128	136	821	98,375	資本財・サービス	
CNH INDUSTRIAL NV	209	243	195	23,356	資本財・サービス	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	193.5	193.5	139	16,699	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	—	28.35	146	17,595	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,125.57	4,567.87	9,054	1,083,881	<1.4% >
ユーロ (ベルギー)						
UCB SA	27.5	27.5	169	20,244	ヘルスケア	
KBC GROEP NV	54.5	58	324	38,823	金融	
COLRUYT SA	20	20	96	11,598	生活必需品	
DELHAIZE GROUP	23	—	—	—	その他	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	17	17	130	15,623	金融	
SOLVAY SA	12.5	17	179	21,508	素材	
UMICORE	29.5	22.5	123	14,783	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	174	179	1,770	211,906	生活必需品	
AGEAS	47.9	47.9	169	20,299	金融	
PROXIMUS	35	35	93	11,144	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	—	12	60	7,209	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	440.9	435.9	3,117	373,141	<0.5% >
ユーロ (ルクセンブルグ)						
RTL GROUP	10	10	64	7,761	一般消費財・サービス	
ARCELORMITTAL	213	423	298	35,706	素材	
SES	69.5	83.5	173	20,729	一般消費財・サービス	
TENARIS SA	105.5	105.5	149	17,856	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	398	622	685	82,053	<0.1% >
ユーロ (フランス)						
JCDECAUX SA	—	16	39	4,697	一般消費財・サービス	
SFR GROUP SA	23	23	53	6,425	電気通信サービス	
TOTAL SA	471	521.5	2,290	274,164	エネルギー	
MICHELIN (CGDE)	40	42	425	50,977	一般消費財・サービス	
AIR LIQUIDE SA	75.48	90.48	858	102,726	素材	

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	千ユーロ	千円		
KERING	16	18	367	44,029	一般消費財・サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	123	132	820	98,199	資本財・サービス	
BOUYGUES SA	42.5	46.5	148	17,736	資本財・サービス	
BNP PARIBAS	231.5	249	1,354	162,111	金融	
PEUGEOT SA	93.5	112.5	156	18,785	一般消費財・サービス	
NATIXIS	201.5	229.5	107	12,848	金融	
THALES SA	22.5	25.5	235	28,176	資本財・サービス	
DANONE	126	138	826	98,913	生活必需品	
CARREFOUR SA	121	129	286	34,271	生活必需品	
SUEZ	63.75	74.75	98	11,842	公益事業	
VIVENDI	250.41	237.41	427	51,152	一般消費財・サービス	
L'OREAL	55	59.5	958	114,773	生活必需品	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	105	115	466	55,894	資本財・サービス	
LEGRAND SA	57.17	63.67	329	39,440	資本財・サービス	
ALCATEL-LUCENT SA	602	—	—	—	その他	
CASINO GUICHARD PERRACHON	13	13	55	6,673	生活必需品	
PERNOD RICARD SA	47.17	49.17	482	57,708	生活必需品	
SOCIETE BIC SA	6	7	85	10,218	資本財・サービス	
EURAZEO	10.24	10.75	54	6,545	金融	
REXEL SA	60.5	70.5	101	12,139	資本財・サービス	
SOCIETE GENERALE SA	158	180	718	85,968	金融	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	60.5	65.5	1,118	133,873	一般消費財・サービス	
ACCOR SA	44	40	134	16,046	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI	35	39	295	35,381	情報技術	
VALEO SA	16.5	56.5	298	35,688	一般消費財・サービス	
PUBLICIS GROUPE	41	46	281	33,714	一般消費財・サービス	
BUREAU VERITAS SA	60.5	60.5	106	12,742	資本財・サービス	
EIFFAGE	—	13	81	9,748	資本財・サービス	
SODEXO	20.5	23	235	28,191	一般消費財・サービス	
INGENICO GROUP	12	12	88	10,609	情報技術	
ZODIAC AEROSPACE	42	48	100	11,982	資本財・サービス	
ESSILOR INTERNATIONAL	44.5	49	490	58,682	ヘルスケア	
AXA SA	429	455	1,001	119,819	金融	
CHRISTIAN DIOR SE	12	13	237	28,375	一般消費財・サービス	
LAGARDERE SCA	26.5	26.5	61	7,311	一般消費財・サービス	
TECHNIP SA	22	25.5	158	18,933	エネルギー	
EDENRED	47.5	47.5	94	11,337	資本財・サービス	
RENAULT SA	41.5	46	340	40,751	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL	5.7	6.2	237	28,472	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU	—	5.5	42	5,091	生活必需品	
ATOS SE	18	21.5	211	25,277	情報技術	
DASSAULT SYSTEMES SA	28	30.5	221	26,490	情報技術	
WENDEL	6	6	64	7,767	金融	
ORANGE	433	469	645	77,303	電気通信サービス	
ALSTOM	46.5	36.5	94	11,291	資本財・サービス	
CNP ASSURANCES	37.5	37.5	61	7,399	金融	
SANOFI	254.25	273.75	2,089	250,084	ヘルスケア	
VINCI SA	103.5	118.5	727	87,049	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	93.5	105.5	172	20,609	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA	221	257	273	32,762	金融	
ENGIE	316.73	341.73	397	47,572	公益事業	
IMERYS SA	9	9	59	7,076	素材	
EDF	55.5	55.5	54	6,581	公益事業	
SAFRAN SA	63.5	74	474	56,778	資本財・サービス	
ILIAD SA	6	6	106	12,704	電気通信サービス	
ARKEMA	15.5	15.5	137	16,432	素材	
ADP	7.5	7.5	69	8,292	資本財・サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	40.5	40.5	68	8,214	一般消費財・サービス	
SCOR SE	34	41	122	14,622	金融	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	104.5	104.5	86	10,329	資本財・サービス	
BOLLORE	166	190	57	6,934	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,035.9 63銘柄	5,972.41 65銘柄	23,347	2,794,752 <3.5%>	
ユーロ (ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BAYER AG-REG	180.5	195.5	1,735	207,733	ヘルスケア	
EVONIK INDUSTRIES AG	30	38	98	11,799	素材	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	299.5	321.5	471	56,416	金融	
COMMERZBANK AG	229.85	246.85	158	18,949	金融	
VOLKSWAGEN AG	8	8	103	12,444	一般消費財・サービス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	35.5	43.5	533	63,837	一般消費財・サービス	
MAN SE	8.5	8.5	79	9,500	資本財・サービス	
SIEMENS AG-REG	173	179	1,899	227,333	資本財・サービス	
E.ON SE	445	465	289	34,620	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	72.5	77.5	629	75,327	一般消費財・サービス	
GEA GROUP AG	42	42	147	17,688	資本財・サービス	
OSRAM LICHT AG	19.1	21.6	102	12,329	資本財・サービス	
CONTINENTAL AG	24.5	25.5	428	51,264	一般消費財・サービス	
BASF SE	201	216.5	1,703	203,899	素材	
LINDE AG	40.5	44	660	79,054	素材	
K+S AG-REG	44	44	83	9,964	素材	

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		
ALLIANZ SE-REG	98.5	106.8	1,606	192,270	金融	
THYSSENKRUPP AG	78	85	178	21,417	素材	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	39	42	454	54,421	生活必需品	
RWE AG	108	118	141	16,977	公益事業	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50.5	50.5	62	7,510	資本財・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	9	9	49	5,865	資本財・サービス	
BRENNTAG AG	34	36.5	178	21,314	資本財・サービス	
FRESENIUS SE & CO KGAA	84	97	662	79,325	ヘルスケア	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	27	27	97	11,722	情報技術	
HOCHTIEF AG	—	5	66	7,924	資本財・サービス	
SAP SE	214.92	231.42	1,844	220,749	情報技術	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	36.5	38.7	669	80,094	金融	
SCHAEFFLER AG	—	38	46	5,567	一般消費財・サービス	
ZALANDO SE	—	19	68	8,152	一般消費財・サービス	
HEIDELBERGCEMENT AG	31	33	277	33,208	素材	
COVESTRO AG	—	16	94	11,251	素材	
INNOGY SE	—	34	114	13,658	公益事業	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	34	37	178	21,334	一般消費財・サービス	
BEIERSDORF AG	21.5	23	177	21,256	生活必需品	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	—	15	55	6,701	素材	
MERCK KGAA	29	31	295	35,359	ヘルスケア	
ADIDAS AG	45.7	44.2	616	73,752	一般消費財・サービス	
HENKEL AG & CO KGAA	22	24	226	27,093	生活必需品	
METRO AG	37	41	114	13,675	生活必需品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	694	754	1,114	133,395	電気通信サービス	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	48.5	50.5	373	44,731	ヘルスケア	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	210.5	225	1,429	171,129	一般消費財・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	247.5	270	432	51,758	情報技術	
HANNOVER RUECK SE	14	14	140	16,774	金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	212	231	676	80,975	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	41.5	—	—	—	金融	
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	—	46	347	41,643	金融	
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	47.5	50.5	160	19,222	一般消費財・サービス	
LANXESS AG	19.5	22	127	15,207	素材	
AXEL SPRINGER SE	—	10	40	4,895	一般消費財・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	76.5	82	240	28,739	不動産	
SYMRISE AG	28	30	170	20,443	素材	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	5.5	—	—	—	一般消費財・サービス	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	128	165	59	7,131	電気通信サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	—	12	82	9,835	一般消費財・サービス	
HUGO BOSS AG -ORD	14	16.5	89	10,730	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	104	109	336	40,237	不動産	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,744.07 49銘柄	5,266.57 56銘柄	23,221	2,779,621 <3.5%>	
ユーロ (ポルトガル)						
JERONIMO MARTINS	60	60	89	10,704	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	495	495	134	16,057	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	103.5	103.5	126	15,133	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	658.5 3銘柄	658.5 3銘柄	350	41,895 <0.1%>	
ユーロ (スペイン)						
TELEFONICA SA	969.27	1,046.27	826	98,925	電気通信サービス	
ENDESA SA	68.5	76.5	149	17,888	公益事業	
BANCO POPULAR ESPANOL	404.73	754.73	59	7,109	金融	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,371.12	1,534.12	886	106,140	金融	
IBERDROLA SA	1,162.34	1,271.34	728	87,214	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	1,077.16	1,319.09	151	18,189	金融	
BANKINTER SA	131	151	104	12,561	金融	
REPSOL SA	223	257	310	37,161	エネルギー	
GRIFOLS SA	33.5	67	123	14,796	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	3,121.5	3,438.5	1,465	175,418	金融	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	101	149	185	22,213	資本財・サービス	
AMADEUS IT GROUP SA	96	100	428	51,321	情報技術	
GAS NATURAL SDG SA	74.5	84.5	137	16,466	公益事業	
MAPFRE SA	214.5	214.5	60	7,245	金融	
CAIXABANK S. A	538	748	203	24,335	金融	
CAIXABANK S. A-RTS	—	748	2	349	その他	
ZARDOYA OTIS SA	45.5	45.5	33	3,986	資本財・サービス	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	180	180	94	11,294	資本財・サービス	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	37.76	44.76	122	14,704	資本財・サービス	
AENA SA	14.5	16	203	24,380	資本財・サービス	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	239	253	821	98,287	一般消費財・サービス	
ENAGAS SA	47	54	126	15,173	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	25	100	169	20,343	公益事業	
FERROVIAL SA	98	117	195	23,402	資本財・サービス	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	187	157	70	8,434	生活必需品	
BANKIA SA	1,084.22	1,084.22	89	10,668	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,544.1 25銘柄	14,011.03 26銘柄	7,752	928,014 <1.2%>	

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	千ユーロ	千円	
ユーロ (イタリア)					
UNIPOLSAI SPA	217.5	217.5	38	4,605	金融
BANCO POPOLARE SC	83	—	—	—	金融
PRYSMIAN SPA	57	48	108	12,973	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	253.43	278.43	324	38,793	金融
SAIPEM SPA	61	1,343	51	6,219	エネルギー
MEDIOBANCA SPA	146.15	146.15	91	10,977	金融
UNICREDIT SPA	1,037.69	1,235.69	239	28,694	金融
TELECOM ITALIA SPA	2,457.82	2,582.82	181	21,734	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP	1,349.5	1,349.5	78	9,385	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO-RSP	—	210	39	4,776	金融
INTESA SANPAOLO	2,745.97	2,985.97	608	72,842	金融
ATLANTIA SPA	89.07	99.07	201	24,156	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	—	118	67	8,135	金融
ENI SPA	544	598	757	90,621	エネルギー
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	112.25	95.25	116	13,886	資本財・サービス
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	508.15	—	—	—	金融
ENEL SPA	1,515	1,778.34	673	80,676	公益事業
SNAM SPA	444	582	204	24,480	エネルギー
LUXOTTICA GROUP SPA	37	37	179	21,484	一般消費財・サービス
UBI BANCA SPA	196	—	—	—	金融
TERNA SPA	322	354	142	17,110	公益事業
ENEL GREEN POWER SPA	404	—	—	—	その他
EXOR SPA	21	25	98	11,823	金融
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	12,601.53 21 銘柄	14,083.72 19 銘柄	4,205 <0.6%>	503,378
ユーロ (フィンランド)					
UPM-KYMMENE OYJ	113	124	266	31,882	素材
NOKIA OYJ	776.5	1,358.5	546	65,370	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	32	32	127	15,244	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	131	131	118	14,222	素材
METSO OYJ	30	30	78	9,437	資本財・サービス
ELISA OYJ	35.5	35.5	106	12,701	電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS	96.5	103	427	51,116	金融
FORTUM OYJ	94.5	104.5	143	17,136	公益事業
KONE OYJ-B	66.5	78.5	323	38,685	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ	30	30	100	12,054	一般消費財・サービス
NESTE OYJ	34.5	29.5	112	13,467	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	20.5	20.5	82	9,884	ヘルスケア
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,460.5 12 銘柄	2,077 12 銘柄	2,432 <0.4%>	291,203
ユーロ (オーストリア)					
OMV AG	35.5	35.5	105	12,609	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	55.5	66.5	171	20,528	金融
VOESTALPINE AG	28.5	28.5	101	12,190	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	24	24	40	4,895	金融
ANDRITZ AG	16	16	77	9,230	資本財・サービス
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	159.5 5 銘柄	170.5 5 銘柄	496 <0.1%>	59,455
ユーロ (その他)					
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	—	52	162	19,460	生活必需品
STMICROELECTRONICS NV	137	153	142	17,052	情報技術
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	137 1 銘柄	205 2 銘柄	305 <0.0%>	36,512
ユ ー ロ 通 貨 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	49,132.57 222 銘柄	54,940 232 銘柄	76,154 <11.5%>	9,115,717
フ ァ ン ド 合 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	283,613.45 1,201 銘柄	291,354.98 1,238 銘柄	— <96.0%>	75,856,759

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首 □ 数	当 □ 数	期末 評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.847	3.197	526	59,215
SIMON PROPERTY GROUP INC	6.587	7.187	1,310	147,291
BOSTON PROPERTIES INC	3.3	3.6	450	50,694
GENERAL GROWTH PROPERTIES	12.1	13.6	348	39,231
VORNADO REALTY TRUST	3.627	3.827	379	42,635
EQUITY RESIDENTIAL	7.9	8.5	514	57,802
EQUINIX INC	1.158	1.608	552	62,075
AMERICAN TOWER CORP	9.1	9.75	1,033	116,240
HOST HOTELS & RESORTS INC	16.093	17.293	299	33,632
KIMCO REALTY CORP	8.7	10	260	29,274
PLUM CREEK TIMBER CO	3.7	—	—	—
VENTAS INC	7	7.9	482	54,237
WEYERHAEUSER CO	11.094	17.614	548	61,701
AGNC INVESTMENT CORP	7.8	7.8	148	16,669
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	6.9	172	19,446
CROWN CASTLE INTL CORP	7.2	7.75	660	74,257
IRON MOUNTAIN INC	3.91	5.61	189	21,272
VEREIT INC	20.4	22.3	189	21,359
PROLOGIS INC	11.062	12.262	630	70,909
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	—	1.7	189	21,351
CAMDEN PROPERTY TRUST	1.8	2	158	17,820
DUKE REALTY CORP	7.3	8	206	23,212
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.4	1.48	319	35,916
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1.5	1.6	226	25,505
WELLTOWER INC	7.4	8.3	532	59,894
HCP INC	9.7	10.7	316	35,605
LIBERTY PROPERTY TRUST	3.3	3.3	131	14,739
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	1.7	159	17,928
MACERICH CO/THE	3	3	207	23,321
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	19.8	23.2	240	27,046
REALTY INCOME CORP	4.8	6	340	38,272
PUBLIC STORAGE	3.1	3.4	712	80,118
REGENCY CENTERS CORP	2.1	2.3	153	17,298
SL GREEN REALTY CORP	2.1	2.25	238	26,819
UDR INC	5.7	6.3	215	24,214
DIGITAL REALTY TRUST INC	2.8	3.7	345	38,891
EXTRA SPACE STORAGE INC	2.3	2.75	194	21,903
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	221.678 34銘柄	258.378 36銘柄	13,590 <1.9% >
(カナダ)				
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	—	1.5	47	3,952
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	—	3	65	5,470
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	—	3.3	88	7,442
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	— —	7.8 3銘柄	201 <0.0% >
(オーストラリア)				
SCENTRE GROUP	116.322	121.922	513	43,188
DEXUS PROPERTY GROUP	23.95	23.95	216	18,176
GPT GROUP	40.06	40.06	189	15,943
MIRVAC GROUP	93.4	93.4	190	16,031
STOCKLAND	51.5	57	244	20,574
WESTFIELD CORP	43.096	45.496	414	34,911
GOODMAN GROUP	38.2	41.7	273	23,051
VICINITY CENTRES	74.873	74.873	213	17,954
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	481.401 8銘柄	498.401 8銘柄	2,256 <0.2% >
(香港)				
LINK REIT	49.5	52	2,750	39,886
香港ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	49.5 1銘柄	52 1銘柄	2,750 <0.1% >
(シンガポール)				
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	48	48	110	8,756
CAPITALAND MALL TRUST	63.2	63.2	120	9,532
SUNTEC REIT	—	53	88	7,010
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	111.2 2銘柄	164.2 3銘柄	320 <0.0% >
(イギリス)				
LAND SECURITIES GROUP PLC	17.1	18.2	177	24,924
SEGRO PLC	16.75	19.95	83	11,729
HAMMERSON PLC	17.4	17.4	95	13,442
BRITISH LAND CO PLC	20.9	22.1	132	18,624
INTU PROPERTIES PLC	21.1	21.1	57	8,049
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	93.25 5銘柄	98.75 5銘柄	546 <0.1% >
ユーロ (フランス)				
UNIBAIL-RODAMCO SE	2.15	2.36	497	59,577
ICADE	0.75	0.75	48	5,815
GECINA SA	0.75	0.95	116	13,992
KLEPIERRE	4.15	5.2	183	22,003
FONCIERE DES REGIONS	0.75	0.75	55	6,647
国小計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	8.55 5銘柄	10.01 5銘柄	902 <0.1% >
合計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	965.579 55銘柄	1,089.539 61銘柄	— <2.5% >

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国 S&P500 (アメリカ)	百万円 1,114	百万円 —

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

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年11月30日現在

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

* 期首における元本額は38,848,551,378円、当期中における追加設定元本額は5,066,388,246円、同解約元本額は3,375,508,519円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国株式インデックスV A725,982,741円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA (一般投資家私募) 32,240,774円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA (一般投資家私募) 463,206,991円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA (一般投資家私募) 50,975,833円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA (一般投資家私募) 1,543,587,080円、ダイワファンドラップ外国株式インデックスエマージングプラス (為替ヘッジなし) 88,958,951円、ダイワファンドラップ外国株式インデックス (為替ヘッジなし) 147,732,667円、D-1's 外国株式インデックス1,957,148円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 182,021円、iFree 外国株式インデックス184,046,036円、iFree 8資産バランス31,235,406円、DCダイワ外国株式インデックス22,444,872,014円、ダイワ・ライフ・バランス30 550,340,778円、ダイワ・ライフ・バランス50 735,584,538円、ダイワ・ライフ・バランス70 553,544,620円、大和DC海外株式インデックスファンド1,470,526,931円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 7,625,022円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 15,729,186円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 3,621,406円、ダイワ世界分散バランスファンド15VA100,000円、ダイワ世界分散バランスファンド20VA197,107円、ダイワ世界分散バランスファンド25VA19,292,523円、ダイワ世界分散バランスファンド30VA163,931,206円、ダイワ世界分散バランスファンド40VA1,955,664,069円、ダイワ世界分散バランスファンド60VA519,301,921円、ダイワ・バランスファンド35VA5,011,815,577円、ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用) 231,056,464円、ダイワ・インデックスセレクト外国株式399,881,832円、ダイワ・ノーロード外国株式ファンド17,952,452円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス3,006,649,223円、ダイワライフスタイル25 23,902,625円、ダイワライフスタイル50 78,118,426円、ダイワライフスタイル75 59,617,537円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,489円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月1日 至2016年11月30日

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

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

《お知らせ》

●投資信託証券への投資制限の変更

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

★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1期

（決算日 2017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1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00~17:00）

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

<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

(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。

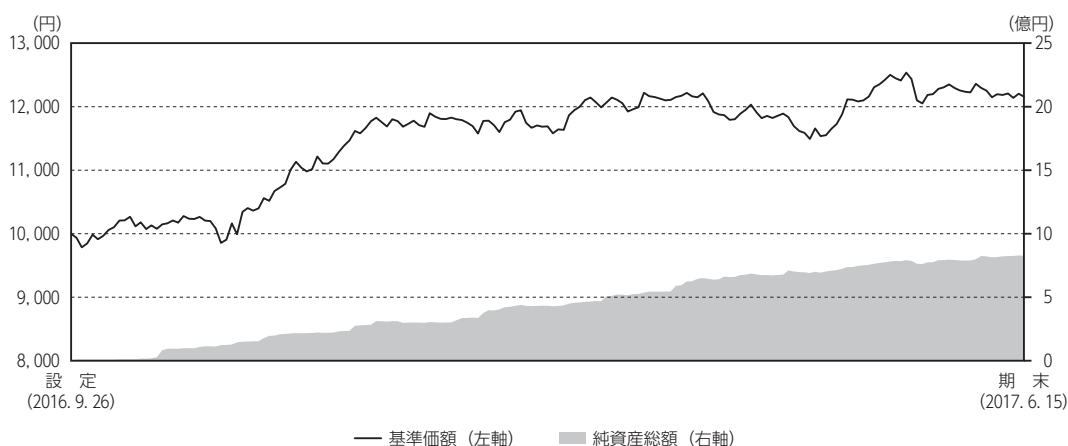
(注2) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(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

設定時：10,000円

期末：12,158円

騰落率：21.6%

■ マザーファンド組入明細

組入ファンド	騰落率
外国株式インデックスマザーファンド	22.7%
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	19.9%

■ 基準価額の変動要因

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。

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
	騰落率				
(設定) 2016年 9 月26日	円 10,000	% —	% —	% —	% —
9 月末	9,913	△ 0.9	95.2	1.1	3.1
10 月末	10,207	2.1	94.7	1.0	3.0
11 月末	11,015	10.2	94.5	1.1	3.2
12 月末	11,682	16.8	94.3	0.7	3.3
2017年 1 月末	11,744	17.4	94.2	1.1	3.5
2 月末	11,961	19.6	94.3	1.3	3.3
3 月末	12,033	20.3	94.7	1.0	2.9
4 月末	12,082	20.8	94.9	0.8	3.0
5 月末	12,235	22.4	94.6	1.3	2.9
(期末) 2017年 6 月15日	12,158	21.6	94.7	1.1	3.0

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2016. 9. 26 ~ 2017. 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、設定時より、中国の貿易統計が予想を下回ったことや、米国大統領選挙を控えてリスク回避姿勢が広がったことなどを背景に、軟調な推移となりました。2016年11月に入ると、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことによる新政権の政策への期待から、市況は米国市場を中心に上昇に転じました。2017年1月以降は、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、市況の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などを受けて上昇し、期を通じては上昇して期末を迎えました。

■先進国為替相場

為替相場は、設定時より、米国の利上げ観測などを受けて米ドル高が進行しました。その後、2016年11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことや12月の米国の利上げにより金利が上昇し、大きく円安が進みました。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月には欧州の政治リスクが後退したことから円安に転じましたが、5月はトランプ大統領のロシアとの不透明な関係をめぐる疑惑への懸念が高まったことなどから、主に米ドルが下落しました。

■新興国株式市況

新興国株式市況は、設定時より、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・金利上昇が進み、新興国からの資金流出が起これ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、トランプ氏の保護主義が経済への悪影響となると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、F R B (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上昇しました。その後は、地域的な要因による変動やトランプ政権の政策実行能力への懐疑的な見方から調整する局面もありましたが、米国の株価が高値で推移するなど堅調な市況環境の中、横ばいの推移で期末を迎えました。

■新興国為替相場

為替相場は、新興国通貨は米ドルに対して横ばいの推移となりました。当期は急激な円高のリバウンド局面であったために米ドル高円安の推移となり、円に対して新興国通貨高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安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。

ポートフォリオについて

(2016. 9. 26 ~ 2017. 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MSCIコクサイ指数（円ベース）との連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

■ダイワ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（DR（預託証券）、ETF（上場投資信託証券）、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96%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、DR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ETF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

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

分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2016年9月26日 ～2017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)	2,158

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

引き続き、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、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。

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2016. 9. 26~2017. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	37円	0.323%	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11,509円です。
（投信会社）	(26)	(0.230)	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）	(9)	(0.078)	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)	(0.016)	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	5	0.044	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(5)	(0.040)	
（先物）	(0)	(0.002)	
（投資信託証券）	(0)	(0.002)	
有価証券取引税	2	0.015	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(2)	(0.015)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
その他費用	17	0.146	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）	(14)	(0.125)	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）	(2)	(0.016)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	61	0.528	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年9月26日から2017年6月15日まで)

項目	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	116,646	158,650	1,427	1,960
外国株式インデックスマザーファンド	310,911	626,559	7,107	14,950

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2016年9月26日から2017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	2,124,690千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,126,801千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.99
項目	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	7,373,682千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	77,808,856千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.09

(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

当期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社(自社)による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
10	—	10	—	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	当期末	
	口数	評価額
	千口	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	161,168
外国株式インデックスマザーファンド	303,803	658,402

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017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	161,168	19.5
外国株式インデックスマザーファンド	658,402	79.6
コール・ローン等、その他	7,270	0.9
投資信託財産総額	826,841	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=109.72円、1カナダ・ドル=82.89円、1オーストラリア・ドル=83.28円、1香港ドル=14.07円、1シンガポール・ドル=79.70円、1ニュージーランド・ドル=79.51円、1台湾ドル=3.63円、1イギリス・ポンド=139.91円、1イスラエル・シケル=31.15円、1スイス・フラン=112.97円、1トルコ・リラ=31.46円、1デンマーク・クローネ=16.56円、1ノルウェー・クローネ=13.03円、1スウェーデン・クローネ=12.61円、1メキシコ・ペソ=6.12円、100チリ・ペソ=16.62円、1インド・ルピー=1.72円、100インドネシア・ルピア=0.83円、1ブラジル・レアル=33.49円、1マレーシア・リンギット=25.80円、1南アフリカ・ランド=8.70円、1タイ・バーツ=3.24円、1ポーランド・ズロチ=29.33円、1ユーロ=123.11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(2,995,374千円)の投資信託財産総額(3,067,243千円)に対する比率は、97.7%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(86,076,984千円)の投資信託財産総額(86,394,814千円)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

2017年6月15日現在

項目	当期末
(A) 資産	826,841,180円
コール・ローン等	7,270,257
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)	161,168,390
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	658,402,533
(B) 負債	743,587
未払信託報酬	734,584
その他未払費用	9,003
(C) 純資産総額(A-B)	826,097,593
元本	679,453,477
次期繰越損益金	146,644,116
(D) 受益権総口数	679,453,477口
1万口当り基準価額(C/D)	12,158円

*設定時における元本額は10,000,000円、当期中における追加設定元本額は702,644,049円、同解約元本額は33,190,572円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は12,158円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月26日 至2017年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,543円
受取利息	31
支払利息	△ 1,574
(B) 有価証券売買損益	48,365,230
売買益	51,223,787
売買損	△ 2,858,557
(C) 信託報酬等	△ 1,426,721
(D) 当期損益金 (A + B + C)	46,936,966
(E) 追加信託差損益金	99,707,150
(配当等相当額)	(△ 796)
(売買損益相当額)	(99,707,946)
(F) 合計 (D + E)	146,644,116
次期繰越損益金 (F)	146,644,116
追加信託差損益金	99,707,150
(配当等相当額)	(△ 796)
(売買損益相当額)	(99,707,946)
分配準備積立金	46,938,509
繰越損益金	△ 1,543

(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	46,938,509
(c) 収益調整金	99,707,946
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	146,646,455
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	146,646,455
(h) 受益権総口数	679,453,477口

「外国株式インデックスマザーファンド」の第17期にかかる運用状況については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「外国株式インデックスマザーファンド」の決算日（2016年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017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。

<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（2016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（2017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124～129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

(2016年9月26日から2017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)	612	55,330	90	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル)	163.7	78,467	479
GAZPROM PAO -SPON ADR (ロシア)	94.45	48,541	513	VALE SA-PREF (ブラジル)	70.8	75,575	1,067
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル)	73.2	39,696	542	PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	135.7	68,715	506
CHINA MOBILE LTD (香港)	29	36,298	1,251	VALE SA (ブラジル)	45.5	51,181	1,124
PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	61.9	36,294	586	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	23.9	32,300	1,351
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	496	36,171	72	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR (ロシア)	16.01	20,611	1,287
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	47	33,349	709	BANCO BRADESCO SA-PREF (ブラジル)	17.9	20,148	1,125
VALE SA-PREF (ブラジル)	27.6	29,395	1,065	LUKOIL PJSC-SPON ADR (ロシア)	2.55	15,627	6,128
LUKOIL PJSC-SPON ADR (ロシア)	4.79	28,864	6,025	BANCO DO BRASIL S. A. (ブラジル)	7.2	8,243	1,144
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	18.9	25,858	1,368	GERDAU SA-PREF (ブラジル)	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9月26日から2017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
POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT (アメリカ)	133	285,485	2,146	POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT (アメリカ)	108	233,959	2,166
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	15.8	2,929	185				
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)	10.33	2,310	223				
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

下記は、2017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(2,177,846千口)の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	株数	2017年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	130	60	6,682	その他
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	117.5	108	11,860	電気通信サービス
VTB BANK JSC -GDR-REG S	437.44	96	10,559	金融
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	27	102	11,283	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	124.7	55	6,059	エネルギー
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	49.5	70	7,717	素材
SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	27.9	13	1,429	電気通信サービス
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	17.7	66	7,245	生活必需品
MEGAFON-REG S GDR	23.2	23	2,531	電気通信サービス
RUSHYDRO PJSC-ADR	116.9	16	1,763	公益事業
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	303.8	317	34,866	金融
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	4.9	53	5,849	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR	100.4	481	52,876	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	210.9	112	12,298	エネルギー
GAZPROM PAO -SPON ADR	1,643.9	667	73,265	エネルギー
SEVERSTAL - GDR REG S	22	26	2,961	素材
ROSSETI PJSC	16,037.2	20	2,276	公益事業
INTER RAO UES PJSC	3,640.2	24	2,655	公益事業
ALROSA PJSC	149.9	21	2,331	素材
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	177	18	1,980	エネルギー
TRANSNEFT PJSC	0.13	36	3,979	エネルギー
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	23,362.17 21銘柄	2,392 262,477	<8.6%>
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	315	322	4,538	資本財・サービス
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	660	400	5,636	一般消費財・サービス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	530	332	4,675	資本財・サービス
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	120	259	3,646	資本財・サービス

銘柄	2017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	
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	85	252	3,551	情報技術
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	150	224	3,157	一般消費財・サービス
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	220	445	6,268	生活必需品
JIANGXI COPPER CO LTD-H	180	219	3,094	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	80	188	2,650	資本財・サービス
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,718	3,057	43,015	エネルギー
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	50	188	2,652	資本財・サービス
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	360	354	4,994	一般消費財・サービス
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	1,920	186	2,620	一般消費財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	380	171	2,411	電気通信サービス
FOSUN INTERNATIONAL LTD	210	264	3,722	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	44	1,220	17,173	情報技術
CHINA TELECOM CORP LTD-H	2,440	915	12,874	電気通信サービス
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	340	158	2,229	一般消費財・サービス
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	1,080	1,216	17,110	電気通信サービス
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	155	212	2,996	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	240	365	5,139	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	3,200	1,606	22,602	エネルギー
CNOOC LTD	2,890	2,528	35,579	エネルギー
HUANENG POWER INTL INC-H	740	427	6,018	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	100	263	3,700	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	310	178	2,507	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	12,160	7,843	110,353	金融
CHINA MOBILE LTD	535	4,507	63,418	電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	174	346	4,881	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,030	488	6,869	金融
GF SECURITIES CO LTD-H	86	135	1,906	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	40	215	3,027	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	520	232	3,270	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	540	1,054	14,830	エネルギー
SINOPHARM GROUP CO-H	100	350	4,931	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	240	528	7,428	不動産
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	110	226	3,180	一般消費財・サービス
YANZHOU COAL MINING CO-H	220	144	2,033	エネルギー
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,670	1,317	18,537	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	50	201	2,838	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,020	334	4,707	金融
CITIC LTD	390	483	6,804	資本財・サービス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	940	274	3,861	金融
IND & COMM BK OF CHINA-H	10,430	5,434	76,456	金融
GUANGDONG INVESTMENT LTD	140	156	2,198	公益事業
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	320	750	10,558	不動産
CRRC CORP LTD - H	170	123	1,736	資本財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	450	454	6,394	資本財・サービス
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	330	1,691	23,795	金融
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	200	285	4,018	不動産
CHINA MINSHENG BANKING-H	774	602	8,472	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	710	645	9,080	不動産
CHINA VANKE CO LTD-H	108	234	3,305	不動産
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	540	684	9,634	金融
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	175	179	2,531	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	110	134	1,897	資本財・サービス
CHINA POWER INTERNATIONAL	630	176	2,481	公益事業
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	520	205	2,889	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	192	576	8,104	金融
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	410	1,016	14,306	金融
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	50	209	2,951	公益事業
KUNLUN ENERGY CO LTD	380	250	3,528	エネルギー
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	232	287	4,047	不動産
CHINA OILFIELD SERVICES-H	220	144	2,036	エネルギー
LENOVO GROUP LTD	1,680	861	12,126	情報技術
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	780	361	5,081	素材
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,231	717	10,097	金融
CHINA EVERGRANDE GROUP	710	1,006	14,165	不動産
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	320	167	2,350	金融
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	2,040	150	2,124	情報技術
CHINA MERCHANTS BANK-H	415	919	12,933	金融
BANK OF CHINA LTD-H	10,600	4,059	57,121	金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	140	224	3,163	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	450	162	2,279	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	180	229	3,226	金融
LONGFOR PROPERTIES	170	257	3,621	不動産
香港ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	79,149 76銘柄	58,007 <26.8%>	816,169
(台湾)	百株	千台湾ドル	千円	
TAIWAN CEMENT	200	685	2,486	素材
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	421.12	2,505	9,095	生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP	286	2,585	9,385	素材
NAN YA PLASTICS CORP	351.4	2,540	9,222	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	283.9	2,572	9,336	素材

銘柄	2017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	千台湾ドル	千円	
CHINA STEEL CORP	806.86	1,972	7,161	素材
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	132.55	799	2,901	一般消費財・サービス
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	196.16	963	3,496	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC	130	2,132	7,739	情報技術
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	599.29	2,238	8,125	情報技術
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	91.41	770	2,797	情報技術
INVENTEC CORP	330	778	2,827	情報技術
QUANTA COMPUTER INC	260	1,809	6,568	情報技術
AU OPTRONICS CORP	2,370	2,855	10,366	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	354	3,823	13,878	電気通信サービス
MEDIATEK INC	160.03	4,000	14,522	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	60	2,166	7,862	情報技術
HTC CORP	222.57	1,517	5,510	情報技術
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	356.17	1,043	3,788	金融
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	714.11	3,302	11,989	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	756.93	3,587	13,023	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	531.81	978	3,552	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	718.28	926	3,363	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	749.93	1,841	6,683	金融
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	605.76	826	3,001	金融
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	850.41	664	2,410	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	1,480.28	2,871	10,424	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	718.22	1,393	5,057	金融
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	50	600	2,178	情報技術
TAIWAN MOBILE CO LTD	110	1,243	4,512	電気通信サービス
WISTRON CORP	588.14	1,764	6,404	情報技術
INNOLUX CORP	2,620	3,576	12,981	情報技術
TPK HOLDING CO LTD	80	720	2,613	情報技術
WPG HOLDINGS LTD	150	594	2,156	情報技術
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	120	916	3,327	電気通信サービス
PEGATRON CORP	340	3,117	11,317	情報技術
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	80	532	1,934	情報技術
POWERTECH TECHNOLOGY INC	74	683	2,482	情報技術
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	70	745	2,706	エネルギー
POU CHEN	144.4	597	2,167	一般消費財・サービス
SILICONWARE PRECISION INDS	120	597	2,169	情報技術
COMPAL ELECTRONICS	374.53	769	2,793	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,080	22,356	81,152	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,411.28	14,395	52,254	情報技術
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	40	1,088	3,949	生活必需品
ASUSTEK COMPUTER INC	47.6	1,337	4,855	情報技術
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,150	1,397	5,072	情報技術
台湾ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	23,387.14 47銘柄	111,186 <13.2%>	403,605
(トルコ)	百株	千トルコ・リラ	千円	
TURKIYE GARANTI BANKASI	291.4	282	8,892	金融
AKBANK T. A. S.	270.9	267	8,403	金融
TURKIYE IS BANKASI-C	238.9	172	5,433	金融
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	98.5	118	3,730	電気通信サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	25.2	255	8,030	エネルギー
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	178.31	113	3,578	素材
HACI OMER SABANCI HOLDING	146.2	159	5,008	金融
TURKIYE HALK BANKASI	135.1	174	5,495	金融
YAPI VE KREDI BANKASI	173.7	77	2,442	金融
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	193.2	126	3,993	金融
KOC HOLDING AS	98.15	164	5,162	資本財・サービス
TURK HAVA YOLLARI AO	157.6	117	3,688	資本財・サービス
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	110	69	2,180	電気通信サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	15.5	100	3,169	生活必需品
トルコ・リラ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,132.66 14銘柄	2,200 <2.3%>	69,212
(メキシコ)	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	4,728	6,850	41,927	電気通信サービス
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	143	1,272	7,788	一般消費財・サービス
CEMEX SAB-CPO	1,748.19	2,924	17,899	素材
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	155	2,663	16,302	生活必需品
GRUPO FIN SANTANDER-B	225	790	4,840	金融
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	42	630	3,859	生活必需品
MEXICHEM SAB DE CV.*	110.23	545	3,341	素材
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	86	402	2,461	生活必需品
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	7.9	331	2,026	素材
ALFA S. A. B. -A	424	1,150	7,039	資本財・サービス
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	302	1,511	9,252	素材
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	157	508	3,110	金融
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	398	1,677	10,269	生活必需品
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	179	1,978	12,107	金融
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,705.32 14銘柄	23,239 <4.7%>	142,224

銘柄	2017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	
(チリ)	百株	千チリ・ペソ	千円	
ENEL CHILE SA	1,523.1	11,266	1,872	公益事業
ENEL GENERACION CHILE SA	266.8	13,520	2,247	公益事業
LATAM AIRLINES GROUP SA	28.8	21,763	3,617	資本財・サービス
CENCOSUD SA	93.4	17,088	2,840	生活必需品
BANCO SANTANDER CHILE	5,410.5	22,864	3,800	金融
ENEL AMERICAS SA	2,074.3	26,534	4,410	公益事業
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5	11,883	1,975	素材
S. A. C. I. FALABELLA	19.1	11,076	1,840	一般消費財・サービス
BANCO DE CHILE	1,945.94	16,988	2,823	金融
チリ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,366.94 9銘柄	152,986 <0.8%>	25,426
(インド)	百株	千インド・ルピー	千円	
TATA STEEL LTD	37.4	1,879	3,233	素材
AXIS BANK LTD	82.4	4,198	7,221	金融
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2	1,470	2,528	一般消費財・サービス
HINDUSTAN UNILEVER LTD	17.6	1,960	3,371	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	63.4	3,466	5,961	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	194.5	5,527	9,507	金融
NTPC LTD	164.9	2,637	4,536	公益事業
JSW STEEL LTD	100	1,982	3,409	素材
INDIAN OIL CORP LTD	132.7	5,582	9,602	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	75.7	5,238	9,010	エネルギー
IDEA CELLULAR LTD	117.6	906	1,558	電気通信サービス
TATA MOTORS LTD-A-DVR	44.4	1,221	2,101	一般消費財・サービス
RURAL ELECTRIFICATION CORP	84.2	1,557	2,678	金融
COAL INDIA LTD	139.1	3,575	6,149	エネルギー
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	17.3	2,008	3,454	金融
GAIL INDIA LTD	29.5	1,124	1,933	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD	119.8	2,397	4,124	素材
WIPRO LTD	60.4	1,546	2,660	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	15.88	3,922	6,747	情報技術
INFOSYS LTD	87.8	8,416	14,476	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD	11.55	2,037	3,505	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD	114.3	5,165	8,885	一般消費財・サービス
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	283.8	519	893	電気通信サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	55.1	9,097	15,647	金融
HDFC BANK LIMITED	8.2	1,370	2,357	金融
ICICI BANK LTD	157.4	5,021	8,637	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD	149.6	20,308	34,930	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	385.75	6,538	11,246	エネルギー
ITC LTD	79.6	2,386	4,105	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	15.7	2,206	3,794	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD	4.7	1,780	3,063	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD	100.2	3,662	6,299	電気通信サービス
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	20.5	1,106	1,902	ヘルスケア
HCL TECHNOLOGIES LTD	18.2	1,553	2,672	情報技術
VEDANTA LTD	80.5	1,899	3,266	素材
インド・ルピー通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,071.68 35銘柄	125,275 <7.1%>	215,473
(インドネシア)	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
UNITED TRACTORS TBK PT	125	346,250	2,873	エネルギー
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,312	1,200,480	9,963	一般消費財・サービス
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	313	267,615	2,221	生活必需品
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	3,218	1,403,048	11,645	電気通信サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	520	338,000	2,805	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	438	787,305	6,534	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	664	830,000	6,889	金融
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	1,334	324,162	2,690	公益事業
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	779	1,156,815	9,601	金融
ADARO ENERGY TBK PT	1,327	220,282	1,828	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 >	10,030 10銘柄	6,873,957 <1.9%>	57,053
(ブラジル)	百株	千ブラジル・リアル	千円	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	804	1,014	33,980	エネルギー
VALE SA-PREF	292	712	23,870	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	328.4	891	29,848	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	347.24	1,264	42,341	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	100	64	2,166	素材
VALE SA	197	514	17,219	素材
GERDAU SA-PREF	172	158	5,316	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	697	943	31,605	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	239.97	185	6,212	公益事業
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	192.29	172	5,770	金融
BRASKEM SA-PREF A	18	58	1,950	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	27	44	1,501	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	214	586	19,630	金融
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	34	41	1,406	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	24	61	2,047	公益事業

銘柄	2017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	千ブラジル・リアル	千円	
EMBRAER SA	84	132	4,439	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF	417	181	6,074	素材
CCR SA	62	103	3,477	資本財・サービス
BRF SA	67	272	9,139	生活必需品
NATURA COSMETICOS SA	25	70	2,360	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	32	98	3,293	公益事業
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	37	59	1,988	公益事業
TIM PARTICIPACOES SA	104.26	98	3,282	電気通信サービス
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	51	235	7,899	電気通信サービス
CPFL ENERGIA SA	35.87	94	3,162	公益事業
LOJAS RENNER S. A.	32.5	88	2,960	一般消費財・サービス
JBS SA	170	114	3,848	生活必需品
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	24	79	2,668	公益事業
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	90	59	2,001	生活必需品
BM&FBOVESPA SA	84	157	5,283	金融
BR MALLS PARTICIPACOES SA	45.08	55	1,849	不動産
CIELO SA	63.28	148	4,971	情報技術
FIBRIA CELULOSE SA	23	85	2,861	素材
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	36	243	8,151	生活必需品
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	10	52	1,771	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45	112	3,755	金融
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	43	330	11,061	エネルギー
KROTON EDUCACIONAL SA	68	97	3,263	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S. A.	80.17	216	7,249	金融
AMBEV SA	284	516	17,291	生活必需品
GRUPO BTG PACTUAL-UNIT	30	43	1,447	金融
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,730.06 41銘柄	10,463 <11.5%>	350,422
	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
(マレーシア)				
MALAYAN BANKING BHD	374	359	9,272	金融
GENTING BHD	108	106	2,747	一般消費財・サービス
PUBLIC BANK BERHAD	226	461	11,894	金融
SIME DARBY BERHAD	397	381	9,853	資本財・サービス
AXIATA GROUP BERHAD	183	91	2,351	電気通信サービス
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	37	91	2,367	生活必需品
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	196	141	3,651	素材
GENTING MALAYSIA BHD	173	101	2,611	一般消費財・サービス
IOI CORP BHD	169	75	1,957	生活必需品
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	633	426	10,991	金融
TENAGA NASIONAL BHD	343	493	12,725	公益事業
PETRONAS GAS BHD	44	83	2,145	公益事業
DIGI. COM BHD	212	105	2,718	電気通信サービス
SAPURA ENERGY BHD	482	93	2,400	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 >	3,577 14銘柄	3,011 <2.6%>	77,687
	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
(南アフリカ)				
GOLD FIELDS LTD	173.6	814	7,087	素材
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	140.9	922	8,029	一般消費財・サービス
SIBANYE GOLD LTD - RTS	110.82	61	537	その他
VODACOM GROUP LTD	55	913	7,947	電気通信サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD	34	694	6,039	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD	25.1	533	4,640	金融
BIDVEST GROUP LTD	21.8	351	3,056	資本財・サービス
BID CORP LTD	28.1	820	7,138	生活必需品
NETCARE LTD	104.6	256	2,231	ヘルスケア
STANDARD BANK GROUP LTD	157.9	2,277	19,813	金融
IMPERIAL HOLDINGS LTD	29.4	471	4,104	一般消費財・サービス
SASOL LTD	98	3,566	31,026	素材
REMGRO LTD	26	544	4,738	金融
EXXARO RESOURCES LTD	23.9	229	1,996	エネルギー
KUMBA IRON ORE LTD	16.5	257	2,239	素材
PICK N PAY STORES LTD	37.7	217	1,891	生活必需品
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	37.2	275	2,399	一般消費財・サービス
SANLAM LTD	157	1,046	9,103	金融
TIGER BRANDS LTD	9.3	351	3,054	生活必需品
FIRSTRAND LTD	260.9	1,243	10,815	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	70.2	445	3,873	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	16.8	242	2,108	一般消費財・サービス
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	69.9	1,039	9,039	金融
NASPERS LTD-N SHS	9.3	2,375	20,664	一般消費財・サービス
INVESTEC LTD	31	295	2,568	金融
MTN GROUP LTD	326.6	3,644	31,710	電気通信サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	120	448	3,903	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	12.2	337	2,934	ヘルスケア
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	41.4	609	5,304	素材
BARLOWORLD LTD	39.1	442	3,852	資本財・サービス
SAPPI LIMITED	68.2	594	5,175	素材
TELKOM SA SOC LTD	40.9	268	2,335	電気通信サービス
MONDI LTD	8.4	276	2,409	素材
MMI HOLDINGS LTD	130.1	258	2,251	金融

銘柄	株数	2017年6月15日現在		業種等	
		評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
SPAR GROUP LIMITED/THE	19.4	千南アフリカ・ランド	301	2,627	生活必需品
MR PRICE GROUP LTD	15.9		259	2,254	一般消費財・サービス
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	83.2		217	1,889	ヘルスケア
SIBANYE GOLD LTD	147		246	2,140	素材
BRAIT SE	36.4		232	2,026	金融
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,833.72 39銘柄	28,386	246,960	<8.1%>
(タイ)	株数	千タイ・パーツ		千円	
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	58	1,104	3,579	金融	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	21	1,092	3,538	素材	
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	41	789	2,557	金融	
KASIKORN BANK PCL-NVDR	32	614	1,990	金融	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	229	3,549	11,500	金融	
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	140	651	2,109	金融	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	128	2,233	7,236	電気通信サービス	
KRUNG THAI BANK - NVDR	773	1,460	4,733	金融	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	528	955	3,096	エネルギー	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	226	2,011	6,516	エネルギー	
IRPC PCL - NVDR	1,488	751	2,434	エネルギー	
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	190	646	2,093	エネルギー	
PTT PCL-NVDR	239	9,177	29,735	エネルギー	
THAI OIL PCL-NVDR	161	1,279	4,147	エネルギー	
CP ALL PCL-NVDR	228	1,413	4,580	生活必需品	
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	159	826	2,678	電気通信サービス	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	516	1,290	4,179	生活必需品	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	295	2,065	6,690	素材	
タイ・パーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,452 18銘柄	31,913	103,398	<3.4%>
(ポーランド)	株数	千ポーランド・ズロチ		千円	
PKO BANK POLSKI SA	90.7	314	9,215	金融	
BANK PEKAO SA	20	261	7,672	金融	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	91.4	403	11,835	金融	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	162	103	3,036	エネルギー	
PGE SA	140.9	164	4,835	公益事業	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	45.8	519	15,239	エネルギー	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	224.8	80	2,367	公益事業	
ENERGA SA	74.3	75	2,207	公益事業	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	29.8	321	9,439	素材	
ポーランド・ズロチ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	879.7 9銘柄	2,245	65,848	<2.2%>
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	179,677.39 347銘柄	—	2,835,961	<93.1%>

(注1) 邦貨換算金額は、2017年6月15日現在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。

(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	口数	2017年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	口数	千アメリカ・ドル	千円
POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT	65	1,292	141,780
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	65 1銘柄	1,292 <4.7%>
(メキシコ)	口数	千メキシコ・ペソ	千円
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	22.5	780	4,776
メキシコ・ペソ通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	22.5 1銘柄	780 <0.2%>
(南アフリカ)	口数	千南アフリカ・ランド	千円
REDEFINE PROPERTIES LTD	30.72	330	2,873
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	22.49	562	4,891
南アフリカ・ランド通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	53.21 2銘柄	892 <0.3%>
合計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	140.71 4銘柄	— <5.1%>

(注1) 邦貨換算金額は、2017年6月15日現在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。

(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。

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6期 (決算日 2016年7月5日)

(計算期間 2015年7月7日～2016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6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いません。
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いません。 ※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

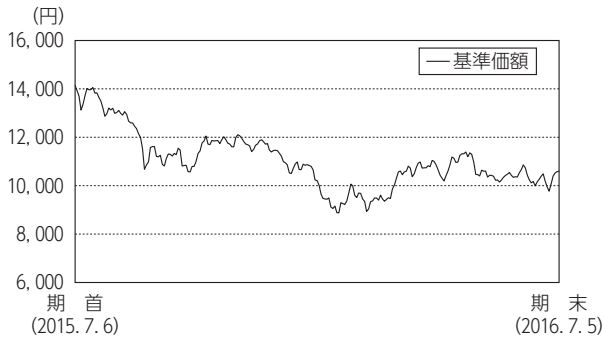
大和投資信託

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：14,135円 期末：10,600円 騰落率：△25.0%

【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下落基調だったことや、為替相場で円高が進んだことからベンチマークが下落し、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。

◆投資環境について

○新興国株式市況

新興国株式市況は、アジアを中心に下落しました。

新興国株式市況は、2015年7月中旬から、ギリシャの債務問題に伴う銀行の営業停止や中国株式市況の急落がリスク回避の動きにつながり、軟調に推移しました。8月後半には、中国株式市場のパニック的な売りによる混乱が世界中に広がる形となり、一段安となりました。その後10月には、米国の年内利上げ観測が後退したことが好材料となり一時下げ止まりました。しかし12月以降は、FRB (米連邦準備制度理事会) の利上げの影響があった上、2016年に入ると中国の株安・通貨安、そして原油安が世界的なリスク回避の動きにつながり、新興国株式市況は大幅に下落しました。2月中旬以降、原油価格が下げ止まったことでリスク回避の動きがやや後退して新興国株式市況は上昇に転じ、3月に入っても中国の全国人民代表大会で政府首脳が経済目標達成に自信を示したことで中国での追加景気対策への期待が高まったことを受けて、引き続き上昇しました。4月以降は、エネルギー価格の上昇などの好材料があったものの、各国の政治的な要因が悪材料となり、一進一退のまま期末を迎えました。

国別では、内需を中心とした中国経済に対する不安が根強く、人民元の先安観も悪材料になった中国株式が大幅に下落し、これがアジア新興国株式市場全体の下落につながりました。インフレと財政赤字が経済への悪影響につながっているブラジル株式、シリア問題やテロの増加など地政学リスクが拡大したトルコ株式も下落しました。一方、2016年に入って原油価格が上昇に転じたことで安心感が広まったロシア株式、新政権による経済政策への期待が高まったインドネシア株式は期を通じて上昇しました。

○為替相場

新興国通貨については、米国が利上げに転じたことから対米ドルでは新興国通貨安となりました。原油価格の下落やウクライナ、シリア問題で欧州との対立が続いていることから資金流出が続いたロシア・ルーブル、財務相が2015年12月に2回交代するなど政治的混乱と経済政策に対する失望が悪材料になった南アフリカ・ランド、大統領の独裁的な経済運営に対する懸念が強まったトルコ・リラ、原油価格の下落と米国大統領候補の主張する政策が実施された場合の悪影響が懸念されたメキシコ・ペソは大幅に下落しました。

一方、対円では、2016年に入り、マイナス金利導入後の金融政策の手詰まり感と、6月の英国国民投票でEU (欧州連合) 離脱派が勝利したことによるリスク回避の動きを受けて大幅な円高が進んだため、対新興国通貨においても大幅な円高となりました。

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) 2015年7月6日	14,135	—	15,201	—	94.3	—	3.5
7月末	13,130	△7.1	14,094	△7.3	92.9	—	3.9
8月末	11,613	△17.8	12,479	△17.9	93.3	—	4.7
9月末	10,570	△25.2	11,310	△25.6	92.4	—	5.2
10月末	11,606	△17.9	12,447	△18.1	92.9	—	5.4
11月末	11,474	△18.8	12,384	△18.5	92.6	—	5.8
12月末	10,799	△23.6	11,627	△23.5	92.1	—	6.1
2016年1月末	9,699	△31.4	10,400	△31.6	91.6	—	6.4
2月末	9,502	△32.8	10,237	△32.7	91.3	—	6.6
3月末	11,043	△21.9	11,918	△21.6	92.5	—	4.9
4月末	11,292	△20.1	12,150	△20.1	93.1	—	4.5
5月末	10,546	△25.4	11,360	△25.3	94.4	—	3.5
6月末	10,389	△26.5	11,212	△26.2	90.8	—	6.5
(期末) 2016年7月5日	10,600	△25.0	11,478	△24.5	90.8	—	6.7

(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。

◆前期における「今後の運用方針」

主として、新興国の株式（D R（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E T F（上場投資信託証券）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。

◆ポートフォリオについて

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。期を通じて、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、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、ベンチマークの下落に対しプラ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、乖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。

■売買および取引の状況

(1) 株式

(2015年7月7日から2016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 319 ()	千アメリカ・ドル 150 ()	百株 689.86	千アメリカ・ドル 388
	香港	百株 10,619 (141.66)	千香港ドル 6,137 (△ 5)	百株 2,803.66	千香港ドル 1,329
	台湾	百株 1,790 (258.91)	千台湾ドル 7,265 (218)	百株 2,576.3	千台湾ドル 10,164
	トルコ	百株 129 ()	千トルコ・リラ 91 ()	百株 14.3	千トルコ・リラ 69
	メキシコ	百株 698 (127.86)	千メキシコ・ペソ 1,073 ()	百株 282.85	千メキシコ・ペソ 777
	チリ	百株 458.6 (1,765.18)	千チリ・ペソ 30,327 ()	百株 101	千チリ・ペソ 31,271
	インド	百株 779.8 (19.2)	千インド・ルピー 13,415 ()	百株 294.8	千インド・ルピー 5,234
	インドネシア	百株 620 ()	千インドネシア・ルピア 354,334 ()	百株 889	千インドネシア・ルピア 452,817
	ブラジル	百株 2,459 (104.51)	千ブラジル・レアル 3,299 (△ 2)	百株 681.6	千ブラジル・レアル 552
	マレーシア	百株 562 (60)	千マレーシア・リンギット 372 ()	百株 443	千マレーシア・リンギット 239
	南アフリカ	百株 473.5 (18.4)	千南アフリカ・ランド 4,377 ()	百株 180.4	千南アフリカ・ランド 1,873
	タイ	百株 307 ()	千タイ・バーツ 2,320 ()	百株 208	千タイ・バーツ 723
ポーランド	百株 117.8 (24.3)	千ポーランド・ズロチ 129 ()	百株 90.9	千ポーランド・ズロチ 70	

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

(2) 投資信託証券

(2015年7月7日から2016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 78 ()	千アメリカ・ドル 1,183 ()	千口 46 ()	千アメリカ・ドル 683 ()
	メキシコ	千口 6.7 ()	千メキシコ・ペソ 260 (△ 2)	千口 — ()	千メキシコ・ペソ — ()
南アフリカ	千口 5.97 ()	千南アフリカ・ランド 101 ()	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

(2015年7月7日から2016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	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	141	143	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	8円
(株式)	(7)
(先物)	(0)
(投資信託証券)	(1)
有価証券取引税	3
(株式)	(3)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	64
(保管費用)	(51)
(その他)	(12)
合 計	74

(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方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。

■主要な売買銘柄

(1) 株式

(2015年7月7日から2016年7月5日まで)

当 期				期 末			
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
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル)	55	14,164	257	SBERBANK PAO -SPONSORED ADR (ロシア)	16.15	12,728	788
PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	44.1	13,933	315	GAZPROM PAO -SPON ADR (ロシア)	24.97	12,289	492
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	11.4	11,648	1,021	HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	29	8,362	288
VALE SA-PREF (ブラジル)	32.4	11,496	354	STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD (南アフリカ)	6.19	4,274	690
VALE SA (ブラジル)	21.8	10,692	490	RELIANCE INDUSTRIES LTD (インド)	2.33	3,981	1,708
BANCO BRADESCO SA-PREF (ブラジル)	10.9	9,038	829	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	7	3,793	541
BANK OF CHINA LTD-H (中国)	178	8,217	46	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H (中国)	48	3,418	71
MTN GROUP LTD (南アフリカ)	6.71	7,212	1,074	VTB BANK JSC -GDR-REG S (ロシア)	13.516	3,353	248
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	97	6,864	70	LUKOIL PJSC-SPON ADR (ロシア)	0.68	3,141	4,620
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	81	4,854	59	ASUSTEK COMPUTER INC (台湾)	3	2,986	995

(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

(2015年7月7日から2016年7月5日まで)

当 期				期 末			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT (アメリカ)	78	132,288	1,696	POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT (アメリカ)	46	76,711	1,667
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	6.7	1,712	255				
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)	2.29	441	192				
REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)	3.68	323	87				

(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	株数	金額	業種等	
					株数	金額
(アメリカ)						
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	90		60		36	3,695
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	84.5		88.5		74	7,593
VTB BANK JSC -GDR-REG S	359.5		255.74		52	5,373
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	16.6		14.9		45	4,682
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	80.8		49		25	2,568
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	28.9		39.1		54	5,584
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	25.9		17.8		14	1,448
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	6.2		7.5		25	2,595
MEGAFON-REG S GDR	9.5		10.8		11	1,205
URALKALI PJSC-SPON GDR-REG S	9.6		—		—	—
SBERBANK PAO -SPONSORED ADR	436.7		294.8		262	26,834
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	3.9		2.9		29	3,034
LUKOIL PJSC-SPON ADR	73.5		75.9		326	33,417
ROSNEFT OJSC-REG S GDR	175.8		153.3		79	8,107
GAZPROM PAO -SPON ADR	888.7		734		321	32,876
SEVERSTAL - GDR REG S	12.5		12.5		13	1,378
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	—		115		8	917
アメリカ・ドル通貨計	2,302.6		1,931.74		1,380	141,312
	銘柄数 < 比率 >	16銘柄	16銘柄		< 9.3% >	
(香港)						
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	140		140		133	1,757
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	210		330		148	1,960
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	250		250		144	1,910
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	40		60		123	1,631
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	—		200		85	1,132
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	100		120		198	2,623
JIANGXI COPPER CO LTD-H	110		120		112	1,479
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,718		2,518		1,415	18,679
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	20		25		113	1,498
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	140		160		132	1,744
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	1,160		1,000		93	1,227
FOSUN INTERNATIONAL LTD	—		75		76	1,005
TENCENT HOLDINGS LTD	17		21		375	4,959
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,040		1,180		417	5,513
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	—		160		97	1,290
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	360		480		389	5,138
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	80		115		115	1,521
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	100		140		160	2,117
PETROCHINA CO LTD-H	1,100		1,560		834	11,016
DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	—		90		52	698

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		
CNOOC LTD	1,270	1,560	1,521	20,077	エネルギー	
HUANENG POWER INTL INC-H	240	320	156	2,061	公益事業	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	45	65	123	1,626	素材	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	120	190	120	1,587	公益事業	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	5,210	6,180	3,182	42,011	金融	
CHINA MOBILE LTD	250	255	2,293	30,277	電気通信サービス	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	—	64	93	1,238	金融	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	390	450	213	2,821	金融	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	—	100	56	747	金融	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	15	20	135	1,788	生活必需品	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	260	315	454	6,004	エネルギー	
SINOPHARM GROUP CO-H	48	44	166	2,198	ヘルスケア	
CHINA RESOURCES LAND LTD	80	100	184	2,428	金融	
YANZHOU COAL MINING CO-H	140	—	—	—	エネルギー	
COSCO PACIFIC LTD	80	100	77	1,019	資本財・サービス	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,620	2,080	596	7,879	金融	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	—	26	73	967	金融	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	—	410	121	1,607	金融	
CITIC LTD	80	320	365	4,823	資本財・サービス	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	—	450	117	1,550	金融	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,800	5,610	2,401	31,694	金融	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	—	80	91	1,212	公益事業	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	140	120	301	3,975	金融	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	240	240	199	2,632	資本財・サービス	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	55	155	538	7,109	金融	
CHINA COAL ENERGY CO-H	340	—	—	—	エネルギー	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	—	130	64	847	金融	
CHINA MINSHENG BANKING-H	294	324	242	3,199	金融	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	410	410	134	1,775	金融	
CHINA VANKE CO LTD-H	51	—	—	—	金融	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	100	140	168	2,221	金融	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	20	125	83	1,107	一般消費財・サービス	
CHINA POWER INTERNATIONAL	—	190	55	729	公益事業	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	280	—	—	—	素材	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	62	90	238	3,148	金融	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	140	230	387	5,118	金融	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	20	20	76	1,012	公益事業	
KUNLUN ENERGY CO LTD	160	200	129	1,705	エネルギー	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	128	96	94	1,253	金融	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	60	—	—	—	エネルギー	
LENOVO GROUP LTD	260	460	217	2,865	情報技術	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	360	360	125	1,653	素材	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	501	621	308	4,065	金融	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	620	310	149	1,972	金融	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	—	220	74	987	金融	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	240	—	—	—	金融	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	180	220	86	1,144	金融	
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	—	34	162	2,143	金融	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	520	780	81	1,081	情報技術	
CHINA MERCHANTS BANK-H	235	260	456	6,026	金融	
BANK OF CHINA LTD-H	4,370	6,150	1,931	25,490	金融	
SOHO CHINA LTD	—	195	73	965	金融	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	—	60	102	1,359	金融	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	—	210	74	984	金融	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	—	68	89	1,179	金融	
LONGFOR PROPERTIES	—	75	77	1,017	金融	
香港ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	32,019 57銘柄	39,976 70銘柄	24,492	323,302 <21.4%>	
(台湾)		百株	百株	千台湾ドル	千円	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	50	65	351	1,116	金融	
TAIWAN CEMENT	170	120	403	1,284	素材	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	203	171.12	1,103	3,509	生活必需品	
FORMOSA PLASTICS CORP	146	116	914	2,906	素材	
NAN YA PLASTICS CORP	171.4	111.4	685	2,178	素材	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	103.9	83.9	689	2,193	素材	
CHINA STEEL CORP	426.86	426.86	894	2,843	素材	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	42.55	82.55	553	1,761	一般消費財・サービス	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	244.52	85.74	401	1,276	情報技術	
DELTA ELECTRONICS INC	60	80	1,280	4,070	情報技術	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	227.5	287.5	1,035	3,291	情報技術	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	100	—	—	—	情報技術	
ACER INC	330	—	—	—	情報技術	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	60.21	60.81	456	1,450	情報技術	
INVENTEC CORP	400	300	700	2,227	情報技術	
QUANTA COMPUTER INC	130	130	808	2,571	情報技術	
AU OPTRONICS CORP	890	1,350	1,512	4,808	情報技術	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	154	174	2,070	6,584	電気通信サービス	
MEDIATEK INC	40.03	80.03	2,044	6,502	情報技術	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	20	20	478	1,520	情報技術	
HTC CORP	112.57	152.57	1,579	5,021	情報技術	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	154	169.4	425	1,352	金融	

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額	評価額		
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千台湾ドル	千円		
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	304.11	434.11	1,621	5,156	金融	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	266.93	436.93	1,535	4,883	金融	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	550.95	550.95	428	1,361	金融	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	200	217.38	416	1,323	金融	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	446.57	458.28	478	1,522	金融	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	329.93	389.93	951	3,025	金融	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	374.89	374.89	464	1,478	金融	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	432.75	450.41	286	910	金融	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	339.19	364.15	351	1,118	金融	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	538.85	722.49	1,224	3,894	金融	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	257.17	307.2	519	1,650	金融	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	20	20	240	763	情報技術	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	100	—	—	—	情報技術	
TAIWAN MOBILE CO LTD	60	60	666	2,117	電気通信サービス	
WISTRON CORP	375.05	386.58	877	2,790	情報技術	
INNOLUX CORP	940	940	1,029	3,273	情報技術	
TPK HOLDING CO LTD	20	60	378	1,203	情報技術	
WPG HOLDINGS LTD	116.3	—	—	—	情報技術	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	60	60	481	1,530	電気通信サービス	
PEGATRON CORP	150	150	1,075	3,420	情報技術	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	30	30	154	490	情報技術	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	94	44	315	1,004	情報技術	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	60	60	517	1,644	エネルギー	
POU CHEN	184.4	154.4	679	2,160	一般消費財・サービス	
SILICONWARE PRECISION INDS	130	90	436	1,389	情報技術	
COMPAL ELECTRONICS	444.53	234.53	473	1,506	情報技術	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	600	600	9,960	31,672	情報技術	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	781.2	610.26	5,083	16,165	情報技術	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	20	20	513	1,631	生活必需品	
ASUSTEK COMPUTER INC	57.6	27.6	745	2,369	情報技術	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	130	132.6	322	1,024	資本財・サービス	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,030	700	885	2,815	情報技術	
台湾ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	13,680.96 54銘柄	13,153.57 50銘柄	51,500 <10.8%>	163,771	
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円		
TURKIYE GARANTI BANKASI	117.2	135.8	105	3,724	金融	
AKBANK T. A. S.	95.1	122.3	103	3,634	金融	
TURKIYE IS BANKASI-C	110.2	144	66	2,345	金融	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	40.4	52.4	55	1,970	電気通信サービス	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	17.7	10.3	65	2,318	エネルギー	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	100.31	126.31	53	1,874	素材	
HACI OMER SABANCI HOLDING	72.2	72.2	68	2,399	金融	
TURKIYE HALK BANKASI	49.5	60.9	52	1,835	金融	
YAPI VE KREDI BANKASI	69.8	69.8	27	984	金融	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	101.9	101.9	46	1,637	金融	
KOC HOLDING AS	56.65	49.75	66	2,327	資本財・サービス	
TURK HAVA YOLLARI AO	32	32	18	646	資本財・サービス	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	46.3	46.3	28	995	電気通信サービス	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5.9	5.9	33	1,192	生活必需品	
トルコ・リラ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	915.16 14銘柄	1,029.86 14銘柄	791 <1.8%>	27,886	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円		
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	1,557	1,854	2,100	11,658	電気通信サービス	
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	59	59	566	3,146	一般消費財・サービス	
CEMEX SAB-CPO	969.13	1,380.14	1,542	8,563	素材	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	57	46	767	4,257	生活必需品	
GRUPO FIN SANTANDER-B	106	106	358	1,991	金融	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	16	16	242	1,347	生活必需品	
MEXICHEM SAB DE CV-*	49	49	190	1,056	素材	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	45	35	209	1,162	生活必需品	
EMPRESAS ICA S. A. B	116	—	—	—	資本財・サービス	
ALFA S. A. B. -A	139	118	362	2,013	資本財・サービス	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	161	179	758	4,211	素材	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	54	68	216	1,202	金融	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	190	163	726	4,032	生活必需品	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	73	61	635	3,524	金融	
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,591.13 14銘柄	4,134.14 13銘柄	8,679 <3.2%>	48,169	
(チリ)	百株	百株	千チリ・ペソ	千円		
ENERSIS CHILE SA	—	1,523.1	11,718	1,825	公益事業	
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	179.8	179.8	10,950	1,706	公益事業	
ENDESA AMERICAS SA	—	179.8	5,480	853	公益事業	
LATAM AIRLINES GROUP SA	15.5	14.8	6,620	1,031	資本財・サービス	
CENCOSUD SA	58.3	37.3	7,138	1,112	生活必需品	
BANCO SANTANDER CHILE	3,898.5	3,898.5	12,327	1,920	金融	
ENERSIS AMERICAS SA	1,140.6	1,523.1	17,239	2,685	公益事業	

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	価額	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
S. A. C. I. FALABELLA	8.6	19.1	9,808	1,528	一般消費財・サービス
EMPRESAS COPEC SA	13.7	—	—	—	エネルギー
BANCO DE CHILE	1,374.05	1,436.33	10,071	1,569	金融
チリ・ペソ通貨計	6,689.05	8,811.83	91,356	14,233	
	銘柄数 < 比率 >	8銘柄	9銘柄	<0.9%>	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
TATA STEEL LTD	44	44	1,457	2,229	素材
AXIS BANK LTD	25.6	25.6	1,392	2,130	金融
HINDUSTAN UNILEVER LTD	8	8	714	1,093	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	17.3	17.3	1,791	2,741	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	84.9	145.2	3,237	4,954	金融
NTPC LTD	128.8	128.8	2,008	3,073	公益事業
JSW STEEL LTD	10	10	1,473	2,254	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	48.4	—	—	—	公益事業
INDIAN OIL CORP LTD	31.4	31.4	1,509	2,309	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	17.2	17.2	1,902	2,910	エネルギー
CAIRN INDIA LTD	—	47.9	708	1,084	エネルギー
IDEA CELLULAR LTD	—	58.4	620	949	電気通信サービス
PUNJAB NATIONAL BANK	59	59	664	1,016	金融
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	13.7	13.7	750	1,148	公益事業
STEEL AUTHORITY OF INDIA	82.1	—	—	—	素材
JINDAL STEEL & POWER LTD	16	99.5	718	1,099	素材
TATA MOTORS LTD-A-DVR	—	27.4	831	1,272	一般消費財・サービス
RURAL ELECTRIFICATION CORP	19.8	42.1	766	1,173	金融
COAL INDIA LTD	27	59.8	1,901	2,909	エネルギー
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	—	11.1	763	1,167	金融
GAIL INDIA LTD	19.2	19.2	761	1,165	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD	89.8	176.5	2,223	3,401	素材
WIPRO LTD	9.7	9.7	544	833	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	7	7	1,745	2,671	情報技術
INFOSYS LTD	38.8	38.8	4,593	7,028	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD	5.45	7.55	1,183	1,811	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD	41.7	70.1	3,291	5,035	一般消費財・サービス
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	30.6	70.1	967	1,480	資本財・サービス
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	124.8	124.8	641	981	電気通信サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	25.1	31.3	3,932	6,016	金融
HDFC BANK LIMITED	14.7	11.3	1,325	2,027	金融
ICICI BANK LTD	89.8	142.2	3,528	5,398	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD	93.7	80.6	7,952	12,167	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	130	93.5	2,169	3,319	エネルギー
ITC LTD	30.1	57.6	1,410	2,158	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	11.7	11.7	1,714	2,623	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD	3.8	2.7	853	1,305	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD	56.9	56.9	2,124	3,250	電気通信サービス
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	—	7.6	585	896	ヘルスケア
VEDANTA LTD	62.1	156.8	2,174	3,326	素材
インド・ルピー通貨計	1,518.15	2,022.35	66,939	102,416	
	銘柄数 < 比率 >	35銘柄	38銘柄	<6.8%>	
(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	98	145,040	1,145	エネルギー
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	760	904	668,960	5,284	一般消費財・サービス
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	111	111	102,675	811	素材
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	160	—	—	—	生活必需品
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	2,330	1,801	714,997	5,648	電気通信サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	235	332	170,980	1,350	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	249	214	283,015	2,235	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	290	338	317,720	2,509	金融
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	372	538	125,892	994	公益事業
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	316	316	339,700	2,683	金融
インドネシア・ルピア通貨計	4,921	4,652	2,868,979	22,664	
	銘柄数 < 比率 >	10銘柄	9銘柄	<1.5%>	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・リアル	千円	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	1,113	1,663	1,641	51,391	エネルギー
VALE SA-PREF	382	706	953	29,863	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	179.16	315.37	810	25,386	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	216.49	352.13	1,087	34,056	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	207	101	93	2,940	素材
VALE SA	242	460	780	24,441	素材
GERDAU SA-PREF	145	218	137	4,300	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	956	1,397	1,679	52,575	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	139.97	165.97	126	3,964	公益事業
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	121.27	224.29	171	5,372	金融
BRASKEM SA-PREF A	31	18	35	1,113	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	57	32	58	1,821	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	176	182	311	9,761	金融
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	—	12	40	1,274	エネルギー

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・リアル	千円	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIR	85	—	—	—	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	15	21	62	1,963	公益事業
EMBRAER SA	33	33	60	1,889	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF	40	—	—	—	素材
OI SA-PREFERENCE	121.6	—	—	—	電気通信サービス
CCR SA	37	49	82	2,589	資本財・サービス
BRF SA	25	37	181	5,667	生活必需品
NATURA COSMETICOS SA	15	15	40	1,263	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	46	36	104	3,275	公益事業
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	29	29	29	933	一般消費財・サービス
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	20	—	—	—	公益事業
SOUZA CRUZ SA	18	—	—	—	その他
TIM PARTICIPACOES SA	51.26	97.26	67	2,101	電気通信サービス
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	25	33	145	4,546	電気通信サービス
CPFL ENERGIA SA	30.95	37.87	84	2,645	公益事業
LOJAS RENNER S. A.	3	24	58	1,839	一般消費財・サービス
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	—	19.2	32	1,009	一般消費財・サービス
JBS SA	58	74	73	2,296	生活必需品
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	15	—	—	—	素材
TRACTEBEL ENERGIA SA	16	16	61	1,930	公益事業
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	33	32	44	1,391	公益事業
BM&FBOVESPA SA	121	110	198	6,199	金融
AES TIETE ENERGIA SA-UNIT	—	23	35	1,097	公益事業
PORTO SEGURO SA	9	12	31	995	金融
BR MALLS PARTICIPACOES SA	25	44.2	56	1,778	金融
CIELO SA	20.06	24.07	81	2,547	情報技術
FIBRIA CELULOSE SA	13	13	29	936	素材
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	10	27	126	3,962	生活必需品
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	—	10	48	1,524	公益事業
SUL AMERICA SA - UNITS	23	23	35	1,104	金融
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	—	46	85	2,677	金融
OI SA	47	—	—	—	電気通信サービス
KLABIN SA - UNIT	21	16	26	827	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	23	25	172	5,404	エネルギー
KROTON EDUCACIONAL SA	—	48	67	2,116	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S. A.	42.12	74.43	202	6,334	金融
AMBEV SA	146	183	348	10,920	生活必需品
GRUPO BTG PACTUAL-UNIT	17	—	—	—	金融
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	10	13	35	1,125	金融
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,209.88 47銘柄	7,091.79 45銘柄	10,640	333,159 <22.0%>
(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	67	49	1,269	資本財・サービス
MALAYAN BANKING BHD	252	190	156	3,998	金融
GENTING BHD	56	77	61	1,584	一般消費財・サービス
PUBLIC BANK BERHAD	103	114	220	5,649	金融
UMW HOLDINGS BHD	40	—	—	—	一般消費財・サービス
SIME DARBY BERHAD	94	94	71	1,824	資本財・サービス
AXIATA GROUP BERHAD	180	180	100	2,577	電気通信サービス
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	—	17	39	1,009	生活必需品
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	73	103	67	1,725	素材
TELEKOM MALAYSIA BHD	53	—	—	—	電気通信サービス
IJM CORP BHD	60	112	38	988	資本財・サービス
IOI CORP BHD	110	110	48	1,231	生活必需品
AMMB HOLDINGS BHD	70	—	—	—	金融
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	233	233	102	2,621	金融
TENAGA NASIONAL BHD	50	169	237	6,075	公益事業
PETRONAS GAS BHD	19	19	41	1,067	公益事業
DIGI. COM BHD	124	124	59	1,512	電気通信サービス
MAXIS BHD	118	85	51	1,325	電気通信サービス
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	—	187	27	698	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 >	1,702 17銘柄	1,881 16銘柄	1,375	35,159 <2.3%>
(南アフリカ)		百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円
GOLD FIELDS LTD	98	89	698	4,905	素材
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	—	48.8	406	2,851	一般消費財・サービス
VODACOM GROUP LTD	17.9	18.2	304	2,140	電気通信サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD	18.4	23.3	389	2,732	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD	13.6	16.1	301	2,113	金融
BIDVEST GROUP LTD	18.2	18.4	253	1,782	資本財・サービス
BID CORP LTD	—	18.4	523	3,676	生活必需品
NETCARE LTD	46.2	59.3	183	1,290	ヘルスケア
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	61.9	—	—	—	その他
STANDARD BANK GROUP LTD	78	99.1	1,251	8,784	金融

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	千南アフリカ・ランド	千円		
IMPERIAL HOLDINGS LTD	15.2	23.8	355	2,494	一般消費財・サービス	
SASOL LTD	40.6	43	1,723	12,095	エネルギー	
REMGRO LTD	9.9	12.3	307	2,159	金融	
KUMBA IRON ORE LTD	9.6	—	—	—	素材	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	18	18	152	1,073	一般消費財・サービス	
SANLAM LTD	67.8	102.2	614	4,311	金融	
TIGER BRANDS LTD	5.8	7.6	279	1,963	生活必需品	
FIRSTRAND LTD	109.4	145.3	634	4,455	金融	
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	147.34	147.34	—	—	その他	
LIBERTY HOLDINGS LTD	9.7	—	—	—	金融	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	25.5	29.7	238	1,675	一般消費財・サービス	
THE FOSCHINI GROUP LTD	8.2	11.7	166	1,170	一般消費財・サービス	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	22.1	27.3	380	2,670	金融	
NASPERS LTD-N SHS	2.3	2.6	576	4,049	一般消費財・サービス	
INVESTEC LTD	13.6	14	122	862	金融	
MTN GROUP LTD	99.9	167	2,411	16,930	電気通信サービス	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	47.6	75.8	400	2,809	素材	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	—	4.9	185	1,300	ヘルスケア	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	53.4	33.1	197	1,384	素材	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	32.8	29	828	5,818	素材	
BARLOWORLD LTD	12.7	27.7	205	1,440	資本財・サービス	
SAPPI LIMITED	36.4	47.1	324	2,274	素材	
TELKOM SA SOC LTD	26.8	26.8	173	1,214	電気通信サービス	
MONDI LTD	4.9	—	—	—	素材	
MMI HOLDINGS LTD	54	70.5	157	1,107	金融	
NAMPAK LTD	—	76	148	1,045	素材	
SPAR GROUP LIMITED/THE	10.9	10.9	218	1,530	生活必需品	
MR PRICE GROUP LTD	—	8.3	172	1,213	一般消費財・サービス	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	27.9	39.6	147	1,034	ヘルスケア	
SIBANYE GOLD LTD	48.6	32.5	180	1,264	素材	
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,313.14 35銘柄	1,624.64 36銘柄	15,616	109,630 <7.2%>	
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円		
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	26	26	430	1,256	金融	
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	11	11	525	1,535	素材	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	39	45	812	2,371	金融	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	53	68	979	2,859	金融	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	41	57	900	2,629	電気通信サービス	
KRUNG THAI BANK - NVDR	183	183	307	897	金融	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	134	—	—	—	エネルギー	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	95	137	1,150	3,360	エネルギー	
IRPC PCL - NVDR	773	773	371	1,083	エネルギー	
PTT PCL-NVDR	79	103	3,234	9,443	エネルギー	
THAI OIL PCL-NVDR	94	68	416	1,216	エネルギー	
CP ALL PCL-NVDR	86	86	445	1,299	生活必需品	
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	39	112	364	1,062	電気通信サービス	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	161	256	723	2,111	生活必需品	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	149	137	811	2,370	素材	
タイ・パーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,963 15銘柄	2,062 14銘柄	11,472	33,498 <2.2%>	
(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	56.6	128	3,300	金融	
BANK PEKAO SA	6.3	7.2	93	2,399	金融	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	2.7	40.1	111	2,864	金融	
ORANGE POLSKA SA	71.6	—	—	—	電気通信サービス	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	—	101	56	1,461	エネルギー	
PGE SA	65	65	74	1,924	公益事業	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	22.5	25.3	171	4,408	エネルギー	
ENERGA SA	19.3	—	—	—	公益事業	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	17.2	17.2	117	3,030	素材	
ポーランド・ズロチ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	261.2 8銘柄	312.4 7銘柄	754	19,388 <1.3%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	76,086.27 330銘柄	88,683.32 337銘柄	—	1,374,594 <90.8%>	

(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	期首 □ 数	当 □ 数	期末 評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ) POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT	千口 25	千口 57	千アメリカ・ドル 939	千円 96,239
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	25 1 銘柄	939	96,239 <6.4%>
(メキシコ) FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	千口 —	千口 6.7	千メキシコ・ペソ 260	千円 1,444
メキシコ・ペソ通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	— 1 銘柄	260	1,444 <0.1%>
(南アフリカ) REDEFINE PROPERTIES LTD GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	千口 12.74 8.76	千口 16.42 11.05	南アフリカ・ランド 188 282	千円 1,322 1,983
南アフリカ・ランド通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	21.5 2 銘柄	470	3,305 <0.2%>
合 計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	46.5 3 銘柄	—	100,989 <6.7%>

(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

2016年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 1,374,594	% 90.0
投資信託証券	100,989	6.6
コール・ローン等、その他	50,948	3.4
投資信託財産総額	1,526,532	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 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。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=102.39円、1香港ドル=13.20円、1台湾ドル=3.18円、1トルコ・リラ=35.25円、1メキシコ・ペソ=5.55円、100チリ・ペソ=15.58円、1インド・ルピー=1.53円、100インドネシア・ルピア=0.79円、1ブラジル・レアル=31.31円、1マレーシア・リングギット=25.57円、1南アフリカ・ランド=7.02円、1タイ・バーツ=2.92円、1ポーランド・ズロチ=25.70円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産(1,497,082千円)の投資信託財産総額(1,526,532千円)に対する比率は、98.1%です。

■損益の状況

当期 自2015年7月7日 至2016年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	45,290,188円
受取配当金	45,248,453
受取利息	43,985
支払利息	△ 2,250
(B) 有価証券売買損益	△ 478,991,071
売買益	77,978,617
売買損	△ 556,969,688
(C) 先物取引等損益	1,712,841
取引益	2,501,475
取引損	△ 788,634
(D) その他費用	△ 8,329,073
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 440,317,115
(F) 前期繰越損益金	518,218,183
(G) 解約差損益金	△ 22,877,125
(H) 追加信託差損益金	30,679,574
(I) 合計 (E + F + G + H)	85,703,517
次期繰越損益金 (I)	85,703,517

(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。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,526,532,979円
コール・ローン等	36,738,462
株式 (評価額)	1,374,594,904
投資信託証券 (評価額)	100,989,317
未収入金	42,612
未収配当金	12,936,631
差入委託証拠金	1,231,053
(B) 負債	12,942,156
未払金	12,931,353
その他未払費用	10,803
(C) 純資産総額 (A - B)	1,513,590,823
元本	1,427,887,306
次期繰越損益金	85,703,517
(D) 受益権総口数	1,427,887,306口
1万口当り基準価額 (C/D)	10,600円

* 期首における元本額は1,253,213,755円、当期中における追加設定元本額は356,031,426円、同解約元本額は181,357,875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) 551,723,434円、D-I's 新興国株式インデックス53,658,668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569,008,026円、ダイワ・インデックスセレクト新興国株式235,685,127円、ダイワ・ノーロード新興国株式ファンド17,812,051円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,600円です。

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1期

（決算日 2017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1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00~17:00）

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

<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

(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。

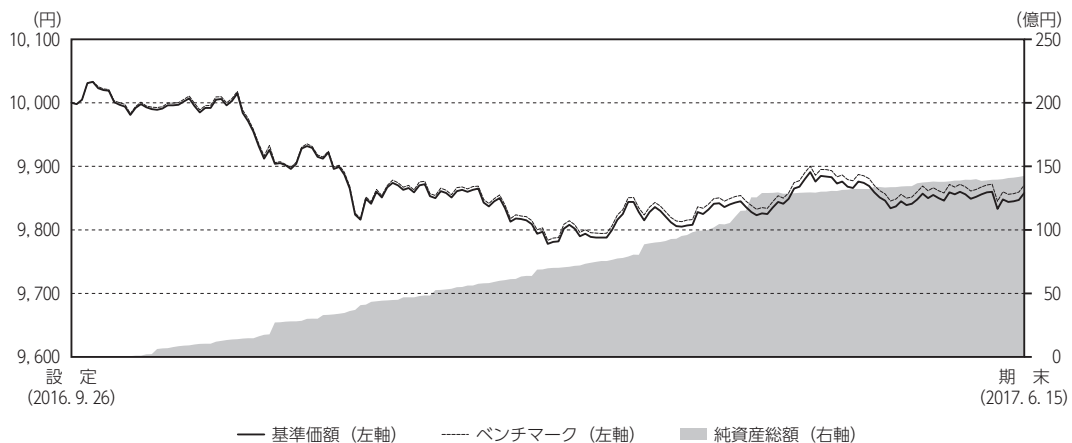
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(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、設定時を10,000として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

設定時：10,000円

期末：9,858円

騰落率：△1.4%

■ 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。

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
	円	騰 落 率 %	(ベンチマーク)	騰 落 率 %		
(設定) 2016年 9月26日	10,000	—	(9/23) 528.431	—	—	—
9月末	10,023	0.2	529.782	0.3	99.4	—
10月末	9,992	△ 0.1	528.193	△ 0.0	99.2	—
11月末	9,929	△ 0.7	524.807	△ 0.7	98.4	—
12月末	9,872	△ 1.3	521.909	△ 1.2	99.2	—
2017年 1月末	9,815	△ 1.9	518.958	△ 1.8	99.2	—
2月末	9,844	△ 1.6	520.564	△ 1.5	99.1	—
3月末	9,828	△ 1.7	519.891	△ 1.6	98.0	—
4月末	9,876	△ 1.2	522.469	△ 1.1	99.5	—
5月末	9,856	△ 1.4	521.440	△ 1.3	98.9	—
(期末) 2017年 6月15日	9,858	△ 1.4	521.587	△ 1.3	99.4	—

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2016. 9. 26 ~ 2017. 6. 15)

国内債券市況

国内長期金利は、設定当初はおおむね横ばい程度で推移しました。その後2016年11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利すると、今後の財政拡大などが意識されて米国の金利が上昇し、国内長期金利も上昇しました。12月には、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て米国の金利がさらに上昇し、国内長期金利も上昇傾向となりました。その後2017年3月にかけては、欧米の長期金利が広めのレンジ内での推移を続ける中、国内長期金利はおおむね横ばい圏で推移しました。4月以降は、弱めの経済指標や地政学的リスクの強まりなどを背景に欧米の長期金利が低下し、国内長期金利も小幅に低下しました。

ポートフォリオについて

(2016. 9. 26 ~ 2017. 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（ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数）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

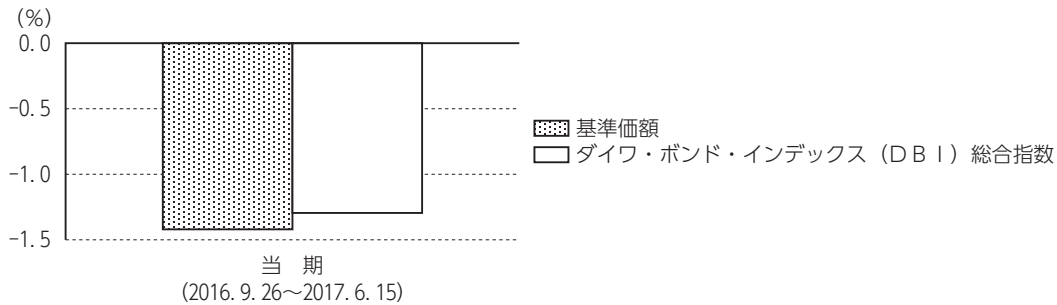
当ファンドの騰落率が、ベンチマーク（ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数）の騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行ないました。期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行ないました。

ベンチマークとの差異について

当期のベンチマークの騰落率は△1.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△1.4%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△0.12%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△0.10%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△0.02%程度となっており、信託報酬要因を除くと、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、分配対象額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。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2016年9月26日 ～2017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)	—

- (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 (2016.9.26~2017.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	10円	0.105%	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9,877円です。
(投信会社)	(6)	(0.058)	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)	(4)	(0.039)	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)	(0.008)	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／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権総口数 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	0	0.004	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権総口数
(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
合計	11	0.109	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年9月26日から2017年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日本債券 インデックス マザーファンド	10,475,360 千口	14,580,909 千円	249,036 千口	346,287 千円

(注) 単位未満は切捨て。

(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。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2016年9月26日から2017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	22,002	1,580	7.2	6,683	617	9.2
コール・ローン	52,448	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合12.5%

※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。

■投信会社(自社)による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	1	—	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表 親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
日本債券インデックス マザーファンド	10,226,323	14,234,020

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本債券インデックス マザーファンド	14,234,020 千円	99.8 %
コール・ローン等、その他	32,963	0.2
投資信託財産総額	14,266,983	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6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	14,266,983,929円
コール・ローン等	32,963,675
日本債券インデックス マザーファンド (評価額)	14,234,020,254
(B) 負債	18,789,497
未払解約金	14,389,292
未払信託報酬	4,240,120
その他未払費用	160,085
(C) 純資産総額 (A - B)	14,248,194,432
元本	14,453,552,894
次期繰越損益金	△ 205,358,462
(D) 受益権総口数	14,453,552,894口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,858円

* 設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は15,709,737,796円、同解約元本額は1,257,184,902円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,858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205,358,462円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月26日 至2017年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 7,553円
受取利息	378
支払利息	△ 7,931
(B) 有価証券売買損益	1,764,738
売買益	2,017,387
売買損	△ 252,649
(C) 信託報酬等	△ 7,824,222
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 6,067,037
(E) 追加信託差損益金	△ 199,291,425
(配当等相当額)	(△ 3,768)
(売買損益相当額)	(△ 199,287,657)
(F) 合計 (D + E)	△ 205,358,462
次期繰越損益金 (F)	△ 205,358,462
追加信託差損益金	△ 199,291,425
(配当等相当額)	(△ 3,768)
(売買損益相当額)	(△ 199,287,657)
繰越損益金	△ 6,067,037

(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	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	0
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	0
(h) 受益権総口数	14,453,552,894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（2016年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017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

(2016年9月26日から2017年6月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
131 5年国債 0.1% 2022/3/20	889,379	366 2年国債 0.1% 2018/7/15	341,705
346 10年国債 0.1% 2027/3/20	844,805	293 10年国債 1.8% 2018/6/20	242,905
129 5年国債 0.1% 2021/9/20	708,775	332 10年国債 0.6% 2023/12/20	209,246
344 10年国債 0.1% 2026/9/20	667,850	340 10年国債 0.4% 2025/9/20	206,760
130 5年国債 0.1% 2021/12/20	636,683	339 10年国債 0.4% 2025/6/20	206,714
368 2年国債 0.1% 2018/9/15	633,637	344 10年国債 0.1% 2026/9/20	201,282
371 2年国債 0.1% 2018/12/15	583,765	107 5年国債 0.2% 2017/12/20	190,898
345 10年国債 0.1% 2026/12/20	541,488	113 5年国債 0.3% 2018/6/20	180,871
128 5年国債 0.1% 2021/6/20	409,945	295 10年国債 1.5% 2018/6/20	178,053
117 5年国債 0.2% 2019/3/20	368,265	292 10年国債 1.7% 2018/3/20	158,237

(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、2017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（45,733,895千円）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	2017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 率 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	47,226,000	51,904,909	81.5	—	53.7	20.1	7.8
地方債証券	4,150,000	4,320,396	6.8	—	3.6	2.5	0.6
特殊債券（除く金融債券）	3,319,000	3,464,165	5.4	—	3.0	1.5	1.0
金融債券	100,000	98,813	0.2	—	0.2	—	—
普通社債券	3,400,000	3,525,861	5.5	—	1.8	3.1	0.6
合 計	58,195,000	63,314,145	99.5	—	62.3	27.1	10.1

(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）

2017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		
国債証券	366 2年国債	0.1000	160,000	160,385	2018/07/15	
	367 2年国債	0.1000	60,000	60,156	2018/08/15	
	368 2年国債	0.1000	630,000	631,719	2018/09/15	
	114 5年国債	0.3000	140,000	140,747	2018/09/20	
	115 5年国債	0.2000	145,000	145,591	2018/09/20	
	296 10年国債	1.5000	25,000	25,510	2018/09/20	
	40 20年国債	2.3000	57,000	58,733	2018/09/20	
	369 2年国債	0.1000	60,000	60,178	2018/10/15	
	370 2年国債	0.1000	60,000	60,190	2018/11/15	
	371 2年国債	0.1000	530,000	531,775	2018/12/15	
	116 5年国債	0.2000	500,000	502,445	2018/12/20	
	297 10年国債	1.4000	70,000	71,597	2018/12/20	
	298 10年国債	1.3000	125,000	127,665	2018/12/20	
	373 2年国債	0.1000	300,000	301,122	2019/02/15	
	374 2年国債	0.1000	320,000	321,251	2019/03/15	
	117 5年国債	0.2000	730,000	734,161	2019/03/20	
	299 10年国債	1.3000	250,000	256,227	2019/03/20	
	300 10年国債	1.5000	286,000	294,128	2019/03/20	
	41 20年国債	1.5000	136,000	139,865	2019/03/20	
	42 20年国債	2.6000	87,000	91,150	2019/03/20	
	376 2年国債	0.1000	250,000	251,047	2019/05/15	
118 5年国債	0.2000	200,000	201,264	2019/06/20		

2017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	
	119 5年国債	0.1000	480,000	482,068	2019/06/20
	301 10年国債	1.5000	120,000	123,889	2019/06/20
	120 5年国債	0.2000	180,000	181,260	2019/09/20
	121 5年国債	0.1000	310,000	311,469	2019/09/20
	303 10年国債	1.4000	60,000	62,054	2019/09/20
	304 10年国債	1.3000	60,000	61,918	2019/09/20
	43 20年国債	2.9000	100,000	106,803	2019/09/20
	122 5年国債	0.1000	580,000	582,981	2019/12/20
	305 10年国債	1.3000	500,000	517,700	2019/12/20
	123 5年国債	0.1000	580,000	583,277	2020/03/20
	306 10年国債	1.4000	255,000	265,585	2020/03/20
	307 10年国債	1.3000	240,000	249,300	2020/03/20
	44 20年国債	2.5000	85,000	91,108	2020/03/20
	45 20年国債	2.4000	78,000	83,389	2020/03/20
	124 5年国債	0.1000	500,000	503,085	2020/06/20
	308 10年国債	1.3000	200,000	208,432	2020/06/20
	309 10年国債	1.1000	90,000	93,252	2020/06/20
	46 20年国債	2.2000	73,000	78,065	2020/06/22
	125 5年国債	0.1000	500,000	503,265	2020/09/20
	310 10年国債	1.0000	130,000	134,668	2020/09/20
	311 10年国債	0.8000	100,000	102,938	2020/09/20
	47 20年国債	2.2000	89,000	95,674	2020/09/21
	126 5年国債	0.1000	650,000	654,569	2020/12/20
	312 10年国債	1.2000	395,000	412,980	2020/12/20
	48 20年国債	2.5000	54,000	58,930	2020/12/21
	127 5年国債	0.1000	535,000	539,023	2021/03/20
	313 10年国債	1.3000	200,000	210,500	2021/03/20
	314 10年国債	1.1000	260,000	271,694	2021/03/20
	49 20年国債	2.1000	64,000	69,308	2021/03/22
	50 20年国債	1.9000	107,000	115,067	2021/03/22
	128 5年国債	0.1000	605,000	609,858	2021/06/20
	315 10年国債	1.2000	221,000	232,498	2021/06/20
	316 10年国債	1.1000	250,000	262,002	2021/06/20
	51 20年国債	2.0000	82,000	88,888	2021/06/21
	129 5年国債	0.1000	700,000	705,831	2021/09/20
	317 10年国債	1.1000	214,000	224,875	2021/09/20
	318 10年国債	1.0000	200,000	209,310	2021/09/20
	52 20年国債	2.1000	52,000	56,854	2021/09/21
	130 5年国債	0.1000	630,000	635,840	2021/12/20
	319 10年国債	1.1000	100,000	105,357	2021/12/20
	320 10年国債	1.0000	170,000	178,338	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	66,000	72,503	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	65,000	71,698	2021/12/20
	131 5年国債	0.1000	880,000	887,972	2022/03/20
	321 10年国債	1.0000	175,000	184,012	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	130,000	136,074	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	140,000	153,893	2022/03/21
	324 10年国債	0.8000	200,000	208,786	2022/06/20
	325 10年国債	0.8000	130,000	135,964	2022/09/20
	327 10年国債	0.8000	150,000	157,167	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	49,387	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,809	2022/12/20
	328 10年国債	0.6000	300,000	311,424	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	106,116	2023/03/20
	329 10年国債	0.8000	355,000	373,278	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	99,921	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	144,566	2023/06/20
	330 10年国債	0.8000	262,000	276,058	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	250,000	260,277	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	101,074	2023/09/20
	332 10年国債	0.6000	100,000	104,275	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	197,394	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	135,000	151,395	2023/12/20
	333 10年国債	0.6000	490,000	511,746	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	62,285	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	138,334	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	126,061	2024/03/20
	334 10年国債	0.6000	470,000	491,464	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	97,255	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	144,712	2024/06/20
	335 10年国債	0.5000	630,000	654,746	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	175,000	202,247	2024/09/20
	336 10年国債	0.5000	175,000	181,975	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	235,000	240,830	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	138,320	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	84,693	2024/12/20

2017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	
	338 10年国債	0.4000	350,000	361,410	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	93,201	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	58,623	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	150,442	2025/03/20
	339 10年国債	0.4000	330,000	340,833	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	70,359	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	58,072	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	61,981	2025/06/20
	340 10年国債	0.4000	600,000	619,806	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	76,000	88,583	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	102,123	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	400,000	409,856	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	109,561	2025/12/20
	84 20年国債	2.0000	100,000	116,958	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	660,000	664,897	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	68,597	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	96,016	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	65,530	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	680,000	684,882	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	120,543	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	93,322	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	460,000	463,183	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	120,000	144,098	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	60,000	72,603	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	520,000	523,447	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	280,000	334,927	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	840,000	844,888	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	119,037	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	156,010	2027/03/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	61,227	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	155,000	186,717	2027/06/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	48,749	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	90,000	108,767	2027/09/20
	99 20年国債	2.1000	200,000	242,460	2027/12/20
	100 20年国債	2.2000	55,000	67,464	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	65,000	81,116	2028/03/20
	102 20年国債	2.4000	80,000	100,188	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	70,000	86,901	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	110,000	134,161	2028/06/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	154,132	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	110,000	135,784	2028/09/20
	107 20年国債	2.1000	107,000	131,263	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	177,000	213,113	2028/12/20
	109 20年国債	1.9000	15,000	18,104	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	110,000	135,315	2029/03/20
	111 20年国債	2.2000	100,000	124,537	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	170,000	209,703	2029/06/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	21,153	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	190,000	235,007	2029/09/20
	114 20年国債	2.1000	130,000	161,213	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	170,000	212,904	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	30,716	2030/02/20
	116 20年国債	2.2000	89,000	111,756	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	195,000	242,422	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	38,125	2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	15,000	18,492	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	112,284	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	210,000	248,043	2030/06/20
	121 20年国債	1.9000	135,000	165,059	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	140,000	169,360	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	48,800	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	140,000	175,205	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	173,000	214,225	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	85,000	107,750	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	70,000	86,803	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	120,000	147,201	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	35,534	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	119,000	146,256	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	160,000	194,472	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	170,336	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	130,000	156,375	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	31,291	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	120,000	144,555	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	185,000	225,450	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	50,000	61,025	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	110,976	2032/03/20

2017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	
	136 20年国債	1.6000	155,000	184,636	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	71,163	2032/05/20
	137 20年国債	1.7000	85,000	102,599	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	87,000	102,428	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	105,000	125,225	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	285,000	344,456	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	33,044	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	50,081	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	170,000	205,715	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	125,000	153,117	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	50,338	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	190,000	227,148	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	120,000	141,550	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	48,476	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	285,000	345,397	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	76,501	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	245,000	297,008	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	94,529	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	150,000	179,535	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	108,770	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	225,000	265,731	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	100,000	134,502	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	232,000	273,934	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	100,000	134,765	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	250,000	291,055	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	80,000	106,609	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	240,000	271,185	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	105,454	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	280,000	316,338	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	75,186	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	280,000	320,969	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	60,000	81,366	2035/09/20
	154 20年国債	1.2000	300,000	338,526	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	79,367	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	200,000	218,416	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	70,000	95,141	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	253,000	248,873	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	60,000	81,675	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	308,000	290,952	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	125,418	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	243,000	242,147	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	199,042	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	190,000	192,350	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	150,000	202,138	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	355,000	365,461	2037/03/20
	27 30年国債	2.5000	120,000	164,292	2037/09/20
	28 30年国債	2.5000	137,000	188,333	2038/03/20
	29 30年国債	2.4000	165,000	224,370	2038/09/20
	30 30年国債	2.3000	167,000	224,427	2039/03/20
	31 30年国債	2.2000	155,000	205,708	2039/09/20
	32 30年国債	2.3000	190,000	256,973	2040/03/20
	33 30年国債	2.0000	241,000	311,441	2040/09/20
	34 30年国債	2.2000	198,000	265,234	2041/03/20
	35 30年国債	2.0000	240,000	311,472	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	216,000	280,864	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	241,000	308,357	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	159,000	199,994	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	142,000	182,088	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	123,000	154,896	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	128,000	158,206	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	146,000	180,521	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	146,000	180,591	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	140,000	173,231	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	148,000	175,915	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	165,000	196,127	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	167,000	202,901	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	190,000	221,112	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	173,000	201,297	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	170,000	171,400	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	170,000	149,112	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	173,000	160,505	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	195,000	185,688	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	188,000	188,678	2047/03/20
	1 40年国債	2.4000	85,000	121,872	2048/03/20
	2 40年国債	2.2000	116,000	160,574	2049/03/20
	3 40年国債	2.2000	74,000	102,751	2050/03/20

2017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	82,000	114,176	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	167,150	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	137,490	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	151,069	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	150,000	172,836	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	258,000	212,687	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	88,000	86,356	2057/03/20
種別小計	銘柄数	257銘柄			
	金額		47,226,000	51,904,909	
地方債証券	25-3 京都市5年	0.3120	100,000	100,352	2018/09/27
	20-6 愛知県公債	1.7100	100,000	102,409	2018/11/28
	665 東京都公債	1.4300	100,000	102,087	2018/12/20
	21-2 千葉県公債	1.5700	100,000	102,940	2019/05/24
	163 神奈川県公債	1.4000	100,000	102,707	2019/06/20
	21-3 埼玉県公債	1.6400	100,000	103,207	2019/06/25
	76 共同発行地方	1.4000	50,000	51,419	2019/07/25
	21-6 千葉県公債	1.4100	100,000	103,087	2019/09/25
	81 共同発行地方	1.3200	100,000	103,209	2019/12/25
	21-3 広島市公債	1.3400	100,000	103,259	2019/12/25
	21-5 京都市公債	1.4500	100,000	103,759	2020/02/25
	471 名古屋市債	1.2700	100,000	103,655	2020/06/19
	688 東京都公債	0.9400	100,000	102,906	2020/09/18
	90 共同発行地方	1.1200	100,000	103,495	2020/09/25
	22-1 岡山県公債	1.0500	100,000	103,432	2020/11/30
	22-5 京都府公債	1.2600	100,000	104,219	2020/12/21
	699 東京都公債	1.0200	100,000	104,128	2021/09/17
	23-2 島根県公債	1.0300	100,000	104,307	2021/11/25
	108 共同発行地方	1.0100	100,000	104,502	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	104,455	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	103,781	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	104,220	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	103,943	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	103,688	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	103,918	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	103,837	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	103,501	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	103,550	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	103,772	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	102,186	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	104,546	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	207,726	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	103,778	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	102,991	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,430	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	206,430	2025/04/16
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,857	2025/12/19
	19 兵庫県公債20年	1.5700	100,000	116,692	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	116,763	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	107,234	2035/12/20
種別小計	銘柄数	40銘柄			
	金額		4,150,000	4,320,396	
特殊債券 (除く金融債券)	64 政保道路機構	1.6000	219,000	223,155	2018/08/29
	5 中日本高速道路	1.8600	100,000	102,268	2018/09/20
	66 政保道路機構	1.5000	100,000	101,898	2018/09/28
	2 政保地方公営機	1.6000	100,000	102,222	2018/11/16
	24 政保中日本道	1.3000	100,000	102,019	2019/01/22
	14 政保地方公共6	0.1990	100,000	100,474	2020/06/18
	61 道路機構	1.2400	100,000	103,614	2020/06/19
	13 地方公共団体	1.2780	100,000	103,624	2020/06/26
	110 政保道路機構	1.3000	100,000	103,833	2020/06/30
	3 公営企業15年	2.2000	100,000	108,487	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	104,092	2021/10/28
	81 道路機構	1.0300	100,000	104,269	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	104,438	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	104,472	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	104,051	2022/07/29
	39 政保地方公共団	0.8010	100,000	103,897	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	104,094	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	104,006	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	104,384	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	103,581	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	103,579	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	104,130	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	103,349	2023/05/31

2017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	
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	104,479	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,881	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,912	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,370	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	204,763	2025/11/28
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	111,265	2027/08/25
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	111,366	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	121,180	2029/07/31
種別小計	銘柄数	31銘柄			
	金額		3,319,000	3,464,165	
金融債券	19 利付商工債	0.1000	100,000	98,813	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄			
	金額		100,000	98,813	
普通社債券	1 明治安田2013基	0.8200	100,000	100,659	2018/08/08
	9 ジャパンリアルエステイト	0.4970	100,000	100,271	2018/08/30
	472 関西電力	1.7900	100,000	102,470	2018/11/22
	18 西日本旅客鉄	1.7000	100,000	102,397	2018/12/11
	4 リソナ銀行劣後	2.7660	100,000	105,313	2019/06/20
	46 NTT ファイナンス	0.2500	100,000	100,319	2019/06/20
	14 武田薬品	0.5400	100,000	100,919	2019/07/19
	20 三井住友 BK 劣	2.2100	100,000	104,436	2019/07/24
	164 オリックス	1.1460	100,000	102,177	2019/08/07
	24 太平洋セメント	0.3900	100,000	100,401	2019/09/11
	423 九州電力	0.9590	100,000	101,979	2019/09/25
	62東日本旅客鉄道	1.4240	100,000	103,037	2019/09/27
	8ドイツ銀行 AG ロンドン	0.4700	100,000	99,868	2019/11/14
	29 東日本高速道	0.1800	100,000	100,322	2020/03/19
	260 北陸電力	2.3300	100,000	106,606	2020/05/25
	9 AUST・NZ 銀行	0.3430	100,000	100,416	2020/07/24
	20 東京三菱銀行	2.5700	100,000	107,680	2020/07/27
	15 トヨタファイナンス	1.8000	100,000	105,404	2020/08/21
	17 シティグループ・インク	2.0400	100,000	105,033	2020/09/16
	72東日本旅客鉄道	1.2800	100,000	104,099	2020/12/22
	44 野村ホールディング	0.7230	100,000	101,640	2021/02/25
	2 イオン FS	0.5720	100,000	100,573	2021/03/18
	9三菱 UFJ 信託 BK 劣	1.6800	100,000	105,786	2021/04/28
	11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,720	2022/06/20
	11三菱 UFJ 信託 BK	1.3600	100,000	105,649	2022/06/27
	372 中国電力	1.2040	100,000	105,099	2022/08/25
	4 JX ホールディングス	1.1450	100,000	105,004	2022/12/14
	30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	103,283	2022/12/14
	175 オリックス	1.0640	100,000	104,515	2023/11/24
	21 西日本高速道	0.7540	100,000	103,903	2023/12/20
	1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	103,737	2024/06/26
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,023	2026/08/21
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	120,974	2029/01/29
	107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	111,135	2045/01/27
種別小計	銘柄数	34銘柄			
	金額		3,400,000	3,525,861	
合 計	銘柄数	363銘柄			
	金額		58,195,000	63,314,145	

(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17期 (決算日 2016年11月30日)

(計算期間 2015年12月1日～2016年11月30日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

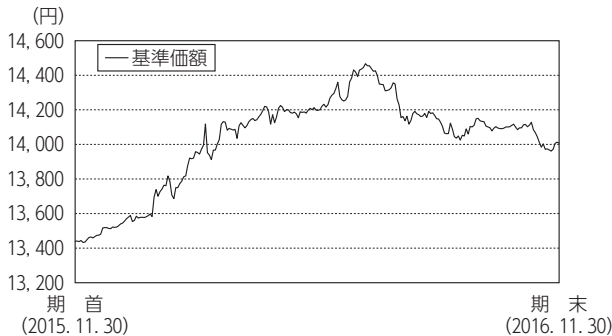
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

◆当期中の基準価額と市況の推移



年月日	基準価額		ダイワ・ボンド・インデックス (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	騰落率	%	%
(期首) 2015年11月30日	13,440	—	503.440	—	98.3	—
12月末	13,522	0.6	506.583	0.6	99.3	—
2016年1月末	13,696	1.9	512.896	1.9	98.5	—
2月末	13,921	3.6	521.658	3.6	98.6	—
3月末	14,035	4.4	525.949	4.5	99.2	—
4月末	14,159	5.3	530.628	5.4	99.0	—
5月末	14,213	5.8	532.551	5.8	98.9	—
6月末	14,392	7.1	539.272	7.1	99.1	—
7月末	14,263	6.1	534.760	6.2	99.4	—
8月末	14,128	5.1	529.357	5.1	99.2	—
9月末	14,137	5.2	529.782	5.2	99.5	—
10月末	14,096	4.9	528.193	4.9	99.3	—
(期末) 2016年11月30日	14,008	4.2	524.807	4.2	98.5	—

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) ダイワ・ボンド・インデックス (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：13,440円 期末：14,008円 騰落率：4.2%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内債券市況

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

◆前期における「今後の運用方針」

今後も、ベンチマーク (ダイワ・ボンド・インデックス (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

当ファンドの騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行ないました。期を通じて、公社債組入比率を99%前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッドの変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行ないました。

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

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

■売買および取引の状況

公 社 債

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

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

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

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

■組入資産明細表

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

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

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

区 分	当 期		末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国債証券	107 5年国債	0.2000	190,000	190,908	2017/12/20
	108 5年国債	0.1000	115,000	115,423	2017/12/20
	289 10年国債	1.5000	48,000	48,880	2017/12/20
	360 2年国債	0.1000	130,000	130,503	2018/01/15
	362 2年国債	0.1000	40,000	40,162	2018/03/15
	109 5年国債	0.1000	50,000	50,211	2018/03/20
	110 5年国債	0.3000	80,000	80,545	2018/03/20
	111 5年国債	0.4000	120,000	120,974	2018/03/20
	290 10年国債	1.4000	132,000	134,769	2018/03/20
	291 10年国債	1.3000	109,000	111,145	2018/03/20
	292 10年国債	1.7000	155,000	158,856	2018/03/20
	38利付国債20年	2.7000	60,000	62,276	2018/03/20

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	
	39 20年国債	2.6000	90,000	93,297	2018/03/20
	363 2年国債	0.1000	70,000	70,297	2018/04/15
	364 2年国債	0.1000	85,000	85,370	2018/05/15
	365 2年国債	0.1000	95,000	95,416	2018/06/15
	112 5年国債	0.4000	150,000	151,384	2018/06/20
	113 5年国債	0.3000	130,000	130,998	2018/06/20
	293 10年国債	1.8000	238,000	245,351	2018/06/20
	294 10年国債	1.7000	147,000	151,312	2018/06/20
	295 10年国債	1.5000	175,000	179,576	2018/06/20
	366 2年国債	0.1000	440,000	441,993	2018/07/15
	367 2年国債	0.1000	60,000	60,286	2018/08/15
	368 2年国債	0.1000	510,000	512,555	2018/09/15
	114 5年国債	0.3000	140,000	141,239	2018/09/20
	115 5年国債	0.2000	145,000	146,007	2018/09/20
	296 10年国債	1.5000	25,000	25,758	2018/09/20
	40 20年国債	2.3000	57,000	59,557	2018/09/20
	116 5年国債	0.2000	498,000	501,839	2018/12/20
	297 10年国債	1.4000	70,000	72,259	2018/12/20
	298 10年国債	1.3000	125,000	128,778	2018/12/20
	117 5年国債	0.2000	400,000	403,408	2019/03/20
	299 10年国債	1.3000	250,000	258,410	2019/03/20
	300 10年国債	1.5000	286,000	296,939	2019/03/20
	41 20年国債	1.5000	136,000	141,234	2019/03/20
	42 20年国債	2.6000	87,000	92,554	2019/03/20
	118 5年国債	0.2000	140,000	141,306	2019/06/20
	119 5年国債	0.1000	330,000	332,237	2019/06/20
	301 10年国債	1.5000	120,000	125,095	2019/06/20
	120 5年国債	0.2000	180,000	181,796	2019/09/20
	121 5年国債	0.1000	50,000	50,358	2019/09/20
	303 10年国債	1.4000	10,000	10,435	2019/09/20
	304 10年国債	1.3000	60,000	62,446	2019/09/20
	43 20年国債	2.9000	100,000	108,591	2019/09/20
	122 5年国債	0.1000	340,000	342,550	2019/12/20
	305 10年国債	1.3000	470,000	490,722	2019/12/20
	123 5年国債	0.1000	300,000	302,331	2020/03/20
	306 10年国債	1.4000	255,000	267,956	2020/03/20
	307 10年国債	1.3000	240,000	251,400	2020/03/20
	44 20年国債	2.5000	85,000	92,399	2020/03/20
	45 20年国債	2.4000	78,000	84,531	2020/03/20
	124 5年国債	0.1000	340,000	342,723	2020/06/20
	308 10年国債	1.3000	150,000	157,617	2020/06/20
	309 10年国債	1.1000	90,000	93,928	2020/06/20
	46 20年国債	2.2000	73,000	79,043	2020/06/22
	125 5年国債	0.1000	400,000	403,356	2020/09/20
	310 10年国債	1.0000	30,000	31,276	2020/09/20
	311 10年国債	0.8000	30,000	31,047	2020/09/20
	47 20年国債	2.2000	89,000	96,869	2020/09/21
	126 5年国債	0.1000	360,000	363,146	2020/12/20
	312 10年国債	1.2000	395,000	416,045	2020/12/20
	48 20年国債	2.5000	54,000	59,736	2020/12/21
	127 5年国債	0.1000	500,000	504,530	2021/03/20
	313 10年国債	1.3000	180,000	190,953	2021/03/20
	314 10年国債	1.1000	260,000	273,577	2021/03/20
	49 20年国債	2.1000	64,000	70,097	2021/03/22
	50 20年国債	1.9000	107,000	116,269	2021/03/22
	128 5年国債	0.1000	420,000	423,931	2021/06/20
	315 10年国債	1.2000	221,000	234,125	2021/06/20
	316 10年国債	1.1000	55,000	58,015	2021/06/20
	51 20年国債	2.0000	82,000	89,831	2021/06/21
	129 5年国債	0.1000	330,000	333,260	2021/09/20
	317 10年国債	1.1000	214,000	226,330	2021/09/20
	318 10年国債	1.0000	200,000	210,560	2021/09/20
	52 20年国債	2.1000	52,000	57,506	2021/09/21
	319 10年国債	1.1000	100,000	106,063	2021/12/20
	320 10年国債	1.0000	120,000	126,666	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	66,000	73,368	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	65,000	72,586	2021/12/20
	321 10年国債	1.0000	175,000	185,150	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	50,000	52,634	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	140,000	155,535	2022/03/21
	325 10年国債	0.8000	170,000	178,768	2022/09/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	49,899	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,906	2022/12/20
	328 10年国債	0.6000	100,000	104,302	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	106,901	2023/03/20
	329 10年国債	0.8000	160,000	169,211	2023/06/20

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	
	62 20年国債	0.8000	95,000	100,469	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	145,991	2023/06/20
	330 10年国債	0.8000	262,000	277,573	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	100,000	104,577	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	102,078	2023/09/20
	332 10年国債	0.6000	220,000	230,278	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	85,000	96,793	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	135,000	152,775	2023/12/20
	333 10年国債	0.6000	265,000	277,611	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	62,830	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	139,719	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	127,271	2024/03/20
	334 10年国債	0.6000	320,000	335,504	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	98,331	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	146,197	2024/06/20
	335 10年国債	0.5000	470,000	489,664	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	175,000	204,221	2024/09/20
	336 10年国債	0.5000	175,000	182,483	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	145,000	148,859	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	139,654	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	85,545	2024/12/20
	338 10年国債	0.4000	200,000	207,066	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	94,092	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	59,136	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	151,884	2025/03/20
	339 10年国債	0.4000	390,000	403,848	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	71,028	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	58,648	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	62,620	2025/06/20
	340 10年国債	0.4000	510,000	528,416	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	76,000	89,493	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	103,213	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	460,000	472,700	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	110,773	2025/12/20
	84 20年国債	2.0000	100,000	118,205	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	503,000	507,672	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	69,354	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	97,148	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	66,278	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	500,000	504,530	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	121,902	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	94,338	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	360,000	362,991	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	120,000	145,657	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	60,000	73,416	2026/09/20
	92 20年国債	2.1000	180,000	217,440	2026/12/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	120,220	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	65,000	78,809	2027/03/20
	95 20年国債	2.3000	3,000	3,712	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	100,000	121,637	2027/06/20
	97 20年国債	2.2000	81,000	99,760	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	90,000	109,877	2027/09/20
	99 20年国債	2.1000	170,000	208,180	2027/12/20
	100 20年国債	2.2000	142,000	176,094	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	35,000	44,188	2028/03/20
	102 20年国債	2.4000	80,000	101,352	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	70,000	87,881	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	40,000	49,301	2028/06/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	155,843	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	67,000	83,652	2028/09/20
	107 20年国債	2.1000	107,000	132,794	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	127,000	154,584	2028/12/20
	109 20年国債	1.9000	90,000	109,809	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	90,000	111,999	2029/03/20
	111 20年国債	2.2000	100,000	126,102	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	125,000	156,077	2029/06/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	21,432	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	125,000	156,496	2029/09/20
	114 20年国債	2.1000	130,000	163,174	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	110,000	139,485	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	31,120	2030/02/20
	116 20年国債	2.2000	89,000	113,151	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	140,000	176,162	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	38,639	2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	15,000	18,721	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	113,601	2030/06/20

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	
	120 20年国債	1.6000	146,000	174,456	2030/06/20
	121 20年国債	1.9000	135,000	167,053	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	110,000	134,629	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	49,611	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	140,000	177,562	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	93,000	116,672	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	85,000	109,234	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	70,000	88,001	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	90,000	111,886	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	36,048	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	119,000	148,226	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	95,000	116,983	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	110,000	135,688	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	100,000	121,912	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	31,765	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	72,000	87,906	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	175,000	216,221	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	50,000	61,873	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	112,481	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	80,000	96,622	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	72,323	2032/05/20
	137 20年国債	1.7000	85,000	104,068	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	87,000	103,897	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	55,000	66,510	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	230,000	281,975	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	33,556	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	50,786	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	140,000	171,719	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	90,000	111,783	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	50,989	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	180,000	218,219	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	55,000	65,816	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	49,216	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	215,000	264,327	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	77,770	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	204,000	250,881	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	96,147	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	95,000	115,311	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	110,677	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	207,000	247,843	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	100,000	136,903	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	208,000	248,986	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	60,000	82,235	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	225,000	265,698	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	80,000	108,486	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	190,000	217,785	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	107,284	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	215,000	246,211	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	76,492	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	225,000	261,771	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	60,000	82,827	2035/09/20
	154 20年国債	1.2000	220,000	251,873	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	80,749	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	228,000	252,660	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	70,000	96,940	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	243,000	241,916	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	60,000	83,145	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	218,000	208,394	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	127,797	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	115,000	116,150	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	60,000	81,159	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	110,000	151,155	2037/03/20
	27 30年国債	2.5000	100,000	140,056	2037/09/20
	28 30年国債	2.5000	117,000	164,569	2038/03/20
	29 30年国債	2.4000	135,000	188,007	2038/09/20
	30 30年国債	2.3000	137,000	188,929	2039/03/20
	31 30年国債	2.2000	130,000	177,409	2039/09/20
	32 30年国債	2.3000	155,000	215,916	2040/03/20
	33 30年国債	2.0000	185,000	246,379	2040/09/20
	34 30年国債	2.2000	158,000	218,556	2041/03/20
	35 30年国債	2.0000	195,000	261,847	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	181,000	244,159	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	201,000	267,137	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	119,000	155,857	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	116,000	154,969	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	103,000	135,283	2043/09/20

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	
	41 30年国債	1.7000	113,000	145,829	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	111,000	143,508	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	124,000	160,611	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	120,000	155,715	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	125,000	155,940	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	152,000	189,677	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	147,000	187,629	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	162,000	198,454	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	139,000	170,515	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	150,000	159,864	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	145,000	134,758	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	111,000	109,019	2046/09/20
	1 40年国債	2.4000	85,000	129,228	2048/03/20
	2 40年国債	2.2000	116,000	171,069	2049/03/20
	3 40年国債	2.2000	74,000	110,064	2050/03/20
	4 40年国債	2.2000	82,000	122,809	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	180,440	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	149,014	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	164,316	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	21,000	26,478	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	102,000	93,578	2056/03/20
種別小計	銘 柄 数	261銘柄			
	金 額		36,119,000	40,657,453	
地方債証券	61 共同発行地方	1.5500	100,000	102,206	2018/04/25
	660 東京都公債	1.5800	100,000	102,499	2018/06/20
	25-3 京都市5年	0.3120	100,000	100,637	2018/09/27
	20-6 愛知県公債	1.7100	100,000	103,503	2018/11/28
	665 東京都公債	1.4300	100,000	103,046	2018/12/20
	21-2 千葉県公債	1.5700	100,000	103,996	2019/05/24
	163 神奈川県公債	1.4000	100,000	103,678	2019/06/20
	21-3 埼玉県公債	1.6400	100,000	104,317	2019/06/25
	76 共同発行地方	1.4000	50,000	51,904	2019/07/25
	21-6 千葉県公債	1.4100	100,000	104,068	2019/09/25
	81 共同発行地方	1.3200	100,000	104,129	2019/12/25
	21-3 広島市公債	1.3400	100,000	104,190	2019/12/25
	21-5 京都市公債	1.4500	100,000	104,757	2020/02/25
	471 名古屋市債	1.2700	100,000	104,524	2020/06/19
	688 東京都公債	0.9400	100,000	103,614	2020/09/18
	90 共同発行地方	1.1200	100,000	104,296	2020/09/25
	22-1 岡山県公債	1.0500	100,000	104,191	2020/11/30
	22-5 京都府公債	1.2600	100,000	105,099	2020/12/21
	699 東京都公債	1.0200	100,000	104,851	2021/09/17
	23-2 島根県公債	1.0300	100,000	105,015	2021/11/25
	108 共同発行地方	1.0100	100,000	105,222	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	105,118	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	104,441	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	104,877	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	104,559	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	104,312	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	104,572	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	104,491	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	104,149	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	104,210	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	104,453	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	102,688	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	105,182	2023/09/25
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	104,208	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	103,324	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,856	2025/02/26
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	118,209	2033/12/09
種別小計	銘 柄 数	37銘柄			
	金 額		3,650,000	3,811,406	
特殊債券 (除く金融債券)	32 道路機構	1.6100	100,000	102,046	2018/03/20
	64 政保道路機構	1.6000	219,000	225,179	2018/08/29
	5 中日本高速道路	1.8600	100,000	103,255	2018/09/20
	66 政保道路機構	1.5000	100,000	102,784	2018/09/28
	2 政保地方公営機	1.6000	100,000	103,195	2018/11/16
	24 政保中日本道	1.3000	100,000	102,855	2019/01/22
	61 道路機構	1.2400	100,000	104,258	2020/06/19
	13 地方公共団体	1.2780	100,000	104,458	2020/06/26
	110 政保道路機構	1.3000	100,000	104,716	2020/06/30
	3 公営企業15年	2.2000	100,000	109,851	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	104,934	2021/10/28

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	
	81 道路機構	1.0300	100,000	105,004	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	105,265	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	105,172	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	104,701	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	104,523	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	104,728	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	104,631	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	105,046	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	104,165	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	104,163	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	104,839	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	103,857	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	105,164	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	103,259	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	102,183	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,803	2025/04/28
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	112,183	2027/08/25
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	122,416	2029/07/31
種別小計	銘柄数	29銘柄			
	金額		3,019,000	3,171,646	
金融債券	い752 利付商工債	0.3000	100,000	100,343	2018/01/26
	い757 利付農林債	0.3500	100,000	100,573	2018/06/27
種別小計	銘柄数	2銘柄			
	金額		200,000	200,916	
普通社債券	21 NTT データ	1.6000	100,000	102,006	2018/03/20
	15 NTT ドコモ	1.9600	100,000	102,920	2018/06/20
	1 明治安田2013基	0.8200	100,000	100,986	2018/08/08
	9 ジャパンリアルエステイト	0.4970	100,000	100,488	2018/08/30
	472 関西電力	1.7900	100,000	103,426	2018/11/22
	18 西日本旅客鉄	1.7000	100,000	103,287	2018/12/11
	4 リソな銀行劣後	2.7660	100,000	106,877	2019/06/20
	46 NTT ファイナンス	0.2500	100,000	100,284	2019/06/20
	14 武田薬品	0.5400	100,000	101,152	2019/07/19
	20 三井住友 BK 劣	2.2100	100,000	105,728	2019/07/24
	164 オリックス	1.1460	100,000	102,682	2019/08/07
	24 太平洋セメント	0.3900	100,000	99,964	2019/09/11
	423 九州電力	0.9590	100,000	102,472	2019/09/25
	62東日本旅客鉄道	1.4240	100,000	103,732	2019/09/27
	8ドイツ銀行 AG ロンドン	0.4700	100,000	95,269	2019/11/14
	29 東日本高速道	0.1800	100,000	100,451	2020/03/19
	260 北陸電力	2.3300	100,000	107,805	2020/05/25
	9 AUST・NZ 銀行	0.3430	100,000	100,259	2020/07/24
	20 東京三菱銀行	2.5700	100,000	109,284	2020/07/27
	15 トヨタファイナンス	1.8000	100,000	106,240	2020/08/21
	17 シティグループ・インク	2.0400	100,000	105,966	2020/09/16
	72東日本旅客鉄道	1.2800	100,000	104,577	2020/12/22
	2 イオンFS	0.5720	100,000	100,743	2021/03/18
	9三菱 UFJ 信託 BK 劣	1.6800	100,000	106,667	2021/04/28
	11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,819	2022/06/20
	11三菱 UFJ 信託 BK	1.3600	100,000	106,322	2022/06/27
	372 中国電力	1.2040	100,000	105,980	2022/08/25
	4 JX ホールディングス	1.1450	100,000	105,418	2022/12/14
	30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	103,212	2022/12/14
	175 オリックス	1.0640	100,000	104,624	2023/11/24
	21 西日本高速道	0.7540	100,000	104,457	2023/12/20
	1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	103,114	2024/06/26
種別小計	銘柄数	32銘柄			
	金額		3,200,000	3,308,223	
合 計	銘柄数	361銘柄			
	金額		46,188,000	51,149,645	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	51,149,645	98.4
コール・ローン等、その他	854,412	1.6
投資信託財産総額	52,004,058	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年11月30日現在

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

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

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

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,008円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月1日 至2016年11月30日

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

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

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

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)

運用報告書(全体版) 第1期

(決算日 2017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1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先(コールセンター)

TEL 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

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

<2734>

★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	投資成果をシティ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。	
主要投資対象	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	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、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。 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投資成果をシティ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。	
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	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。

設定以来の運用実績

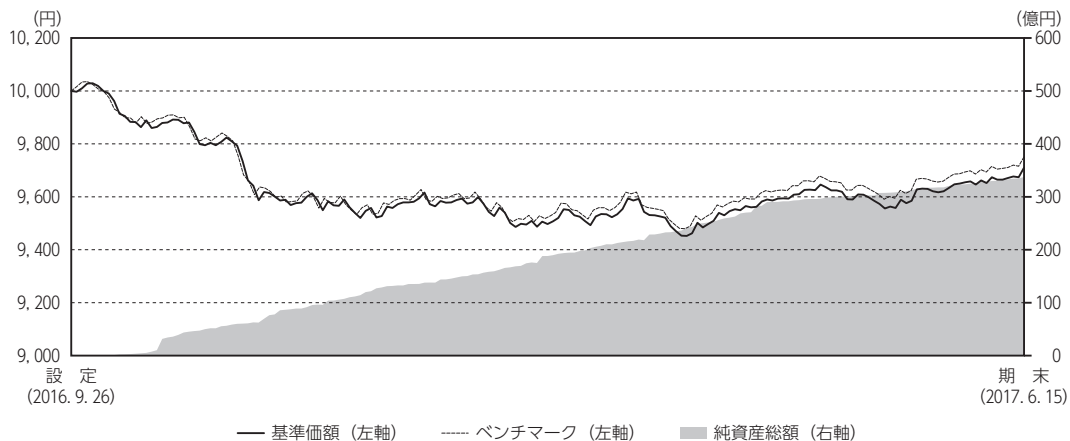
決算期	基準価額			シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) (ベンチマーク)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期 中 騰落率	期 中 騰落率	期 中 騰落率				
1 期末 (2017年 6月15日)	円 9,710	円 0	% △ 2.9	% △ 2.5	% 93.8	% 4.0	百万円 33,745	

- (注1) シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・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2) シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) は、シティ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。
- (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



(注) ベンチマークは、設定時を10,000として指数化したものです。

*ベンチマークは、シティ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

設定時：10,000円
期 末：9,710円
騰落率：△2.9%

■ 基準価額の主な変動要因

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) したため、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		シティ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		
		%		%	%	%
(設定)2016年9月26日	10,000	—	10,000	—	—	—
9月末	10,019	0.2	10,024	0.2	95.6	—
10月末	9,795	△ 2.1	9,812	△ 1.9	93.1	10.7
11月末	9,613	△ 3.9	9,622	△ 3.8	96.3	9.7
12月末	9,616	△ 3.8	9,628	△ 3.7	93.9	7.1
2017年1月末	9,495	△ 5.1	9,514	△ 4.9	91.8	6.9
2月末	9,586	△ 4.1	9,612	△ 3.9	94.9	3.9
3月末	9,560	△ 4.4	9,592	△ 4.1	95.0	8.2
4月末	9,609	△ 3.9	9,643	△ 3.6	96.3	3.2
5月末	9,655	△ 3.5	9,694	△ 3.1	96.2	3.8
(期末)2017年6月15日	9,710	△ 2.9	9,751	△ 2.5	93.8	4.0

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2016.9.26～2017.6.15)

■外国債券市況

主要国の国債金利は、設定時より、ECB（欧州中央銀行）の資産買い入れの減額観測が出たことなどから上昇しました。また、2016年11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利し、今後の財政拡大などが意識されたことも、さらなる金利上昇の要因となりました。12月に米国で利上げが行なわれたことで米国の金利は上昇した一方、欧州では金融緩和が継続されたため金利は低下しました。その後、金利は上下に振れながらもおおむねレンジ内での推移となりました。2017年3月中旬以降は、トランプ政権の政策に対する不透明感などから金利はおおむね低下基調で推移しました。

ポートフォリオについて

(2016.9.26～2017.6.15)

■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

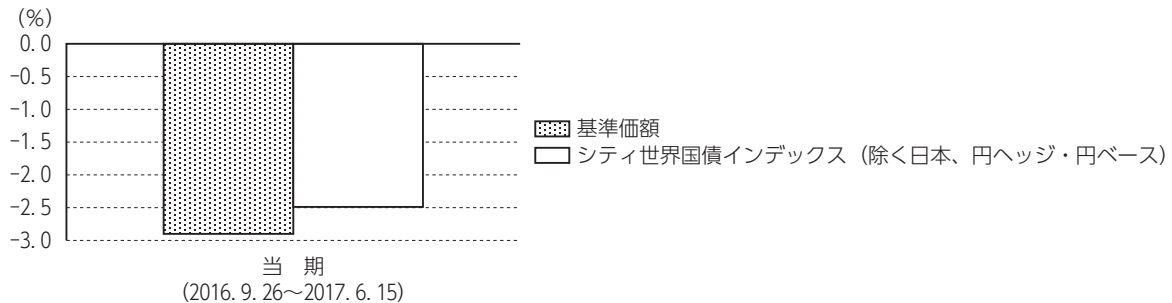
外貨建て資産については為替ヘッジを行ない、またファンドとベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース））の金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

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△2.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△2.9%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。

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0.2%程度でした。



分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2016年9月26日 ～2017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

外貨建て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 (2016.9.26~2017.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	28円	0.296%	信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,630円です。
(投信会社)	(19)	(0.202)	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)	(7)	(0.078)	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)	(0.015)	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	0.007	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)	(1)	(0.007)	
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	4	0.036	その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.030)	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)	(0.006)	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	33	0.339	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年9月26日から2017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	34,848,966	33,537,410	225,693	217,310

(注) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	当期末	
	口数	評価額
	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	33,712,680

(注) 単位未満は切捨て。

■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。

■投信会社(自社)による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
100	—	100	—	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017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	33,712,680	99.6
コール・ローン等、その他	134,318	0.4
投資信託財産総額	33,846,999	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=109.72円、1カナダ・ドル=82.89円、1オーストラリア・ドル=83.28円、1シンガポール・ドル=79.70円、1イギリス・ポンド=139.91円、1スイス・フラン=112.97円、1デンマーク・クローネ=16.56円、1ノルウェー・クローネ=13.03円、1スウェーデン・クローネ=12.61円、1メキシコ・ペソ=6.12円、1マレーシア・リンギット=25.80円、1南アフリカ・ランド=8.70円、1ポーランド・ズロチ=29.33円、1ユーロ=123.11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(32,888,862千円)の投資信託財産総額(34,594,774千円)に対する比率は、95.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	33,846,999,490円
コール・ローン等	134,318,980
外国債券インデックス (為替ヘッジあり)	33,712,680,510
マザーファンド (評価額)	
(B) 負債	101,895,397
未払解約金	73,882,925
未払信託報酬	27,459,056
その他未払費用	553,416
(C) 純資産総額 (A - B)	33,745,104,093
元本	34,752,986,225
次期繰越損益金	△ 1,007,882,132
(D) 受益権総口数	34,752,986,225口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,710円

* 設定時における元本額は100,000,000円、当期中における追加設定元本額は37,021,440,339円、同解約元本額は2,368,454,114円です。
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は9,710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1,007,882,132円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月26日 至2017年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 23,355円
受取利息	1,043
支払利息	△ 24,398
(B) 有価証券売買損益	400,383,358
売買益	403,938,479
売買損	△ 3,555,121
(C) 信託報酬等	△ 54,434,917
(D) 当期損益金 (A + B + C)	345,925,086
(E) 追加信託差損益金	△ 1,353,807,218
(配当等相当額)	(△ 14,068)
(売買損益相当額)	(△ 1,353,793,150)
(F) 合計 (D + E)	△ 1,007,882,132
次期繰越損益金 (F)	△ 1,007,882,132
追加信託差損益金	△ 1,353,807,218
(配当等相当額)	(△ 14,068)
(売買損益相当額)	(△ 1,353,793,150)
分配準備積立金	345,948,441
繰越損益金	△ 23,355

(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	345,948,441
(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)	345,948,441
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	345,948,441
(h) 受益権総口数	34,752,986,225口

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1期（決算日 2017年6月15日）

（計算期間 2016年9月26日～2017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1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、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、投資成果をシティ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投資成果をシティ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

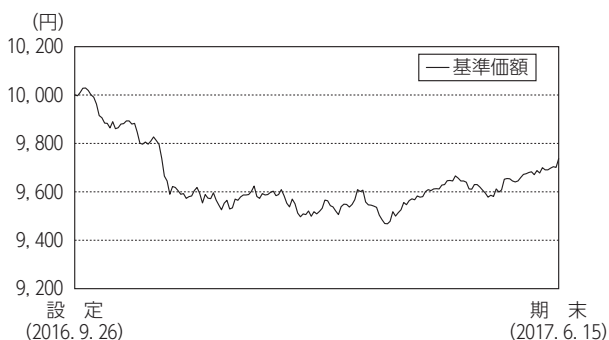
大和投資信託

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】

設定時：10,000円 期末：9,737円 騰落率：△2.6%

【基準価額の主な変動要因】

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）したため、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、設定時より、ECB（欧州中央銀行）の資産買い入れの減額観測が出たことなどから金利は上昇しました。また、2016年11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利し、今後の財政拡大などが意識されたことも、さらなる金利上昇の要因となりました。12月に米国で利上げが行われたことで米国の金利は上昇した一方、欧州では金融緩和が継続されたため金利は低下しました。その後、金利は上下に振れながらもおおむねレンジ内での推移となりました。2017年3月中旬以降は、トランプ政権の政策に対する不透明感などから金利はおおむね低下基調で推移しました。

◆ポートフォリオについて

外貨建て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（シティ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）0.2%程度でした。

《今後の運用方針》

外貨建て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		シティ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		
(設定) 2016年9月26日	10,000	—	10,000	—	—	—
9月末	10,019	0.2	10,024	0.2	95.8	—
10月末	9,797	△ 2.0	9,812	△ 1.9	93.3	10.7
11月末	9,618	△ 3.8	9,622	△ 3.8	96.5	9.8
12月末	9,624	△ 3.8	9,628	△ 3.7	94.1	7.1
2017年1月末	9,506	△ 4.9	9,514	△ 4.9	92.0	6.9
2月末	9,601	△ 4.0	9,612	△ 3.9	95.1	3.9
3月末	9,578	△ 4.2	9,592	△ 4.1	95.2	8.2
4月末	9,630	△ 3.7	9,643	△ 3.6	96.4	3.2
5月末	9,680	△ 3.2	9,694	△ 3.1	96.3	3.8
(期末) 2017年6月15日	9,737	△ 2.6	9,751	△ 2.5	93.8	4.0

(注1) 騰落率は設定比。

(注2) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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、円ヘッジ・円ベース）は、シティ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。

(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。

■1万口当りの費用の明細

項目	当 期
売買委託手数料 (先物)	1円 (1)
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用) (その他)	3 (3) (0)
合 計	4

(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

(2016年9月26日から2017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 140,556	千アメリカ・ドル 10,938 (—)	
	カナダ	千カナダ・ドル 8,878	千カナダ・ドル 915 (—)	
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 8,307	千オーストラリア・ドル 29 (—)	
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,509	千シンガポール・ドル — (—)	
	イギリス	千イギリス・ポンド 16,472	千イギリス・ポンド — (—)	
	スイス	千スイス・フラン 421	千スイス・フラン — (—)	
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 11,484	千デンマーク・クローネ — (—)	
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 6,312	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 10,384	千スウェーデン・クローネ — (—)	
	国	メキシコ	千メキシコ・ペソ 46,073	千メキシコ・ペソ — (—)
		マレーシア	千マレーシア・リンギット 4,017	千マレーシア・リンギット — (—)
		南アフリカ	千南アフリカ・ランド 18,738	千南アフリカ・ランド — (—)
		ポーランド	千ポーランド・ズロチ 6,700	千ポーランド・ズロチ — (—)
		ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 1,993	千ユーロ — (—)

		買付額	売付額
外	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 5,927	千ユーロ — (—)
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 6,791	千ユーロ — (—)
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 27,116	千ユーロ 709 (—)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 20,411	千ユーロ 1,205 (—)
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 15,707	千ユーロ 950 (—)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 25,838	千ユーロ 198 (—)
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 1,472	千ユーロ — (—)
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 3,941	千ユーロ — (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 109,200	千ユーロ 3,064 (—)

(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

(2016年9月26日から2017年6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
外 債券先物取引	百万円 35,245	百万円 33,932	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

公 社 債

(2016年9月26日から2017年6月15日まで)

当 期		期 付	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2018/12/31	1,597,033	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2018/4/30	631,556
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2021/11/15	941,299	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.5% 2018/2/15	449,252
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2019/10/31	938,207	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 0.25% 2018/4/13	128,885
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2019/12/31	783,755	SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン) 0.25% 2018/4/30	97,785
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2018/10/31	654,046	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/9/30	88,036
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2018/4/30	648,619	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4% 2018/4/25	87,978
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/9/30	621,588	CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ) 0.25% 2018/5/1	75,900
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2020/11/15	589,832	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 4.5% 2036/2/15	42,686
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.875% 2020/6/30	589,452	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア) 4.5% 2018/2/1	23,744
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.125% 2021/6/30	566,644	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 3.5% 2019/7/4	19,848

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

■組入資産明細表

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

作成期	当 期				末				
	区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 比 率	残存期間別組入比率		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
				千円	%	%	%	%	%
アメリカ	千アメリカ・ドル 127,503	千アメリカ・ドル 130,461		14,314,191	41.4	—	17.9	16.1	7.3
カナダ	千カナダ・ドル 7,247	千カナダ・ドル 7,984		661,849	1.9	—	0.9	0.5	0.6
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 7,622	千オーストラリア・ドル 8,346		695,073	2.0	—	1.4	0.5	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 1,437	千シンガポール・ドル 1,514		120,713	0.3	—	0.2	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 12,858	千イギリス・ポンド 16,819		2,353,159	6.8	—	4.8	1.7	0.3
スイス	千スイス・フラン 352	千スイス・フラン 416		47,099	0.1	—	0.0	0.1	—
デンマーク	千デンマーク・クローネ 9,040	千デンマーク・クローネ 11,416		189,065	0.5	—	0.4	0.2	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 5,920	千ノルウェー・クローネ 6,324		82,406	0.2	—	0.2	0.0	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 8,800	千スウェーデン・クローネ 10,342		130,423	0.4	—	0.2	0.2	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 44,610	千メキシコ・ペソ 46,353		283,685	0.8	—	0.4	0.3	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 4,100	千マレーシア・リンギット 4,068		104,962	0.3	—	0.2	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 20,130	千南アフリカ・ランド 19,026		165,533	0.5	—	0.4	0.1	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 6,645	千ポーランド・ズロチ 6,797		199,384	0.6	—	0.2	0.3	0.1
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 1,698	千ユーロ 1,999		246,160	0.7	—	0.4	0.3	—
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 4,942	千ユーロ 5,905		726,998	2.1	—	1.4	0.4	0.3
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 5,890	千ユーロ 6,826		840,362	2.4	—	1.9	0.4	0.2
ユーロ (フランス)	千ユーロ 21,646	千ユーロ 26,637		3,279,393	9.5	—	5.8	3.0	0.6
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 15,919	千ユーロ 19,072		2,348,025	6.8	—	4.2	2.1	0.6
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 12,890	千ユーロ 14,821		1,824,649	5.3	—	3.1	1.8	0.4
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 21,536	千ユーロ 25,648		3,157,614	9.1	—	5.6	2.9	0.6
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 1,280	千ユーロ 1,465		180,380	0.5	—	0.4	0.1	—
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 3,350	千ユーロ 3,919		482,551	1.4	—	0.9	0.3	0.2
ユーロ (小計)	89,151	106,296		13,086,136	37.9	—	23.8	11.3	2.8
合計	—	—		32,433,686	93.8	—	51.0	31.4	11.5

(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) 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	当 期				末			償還年月日
	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	5,120	5,306	582,214	2020/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,540	4,870	534,437	2021/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	8,346	8,465	928,808	2021/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,900	3,864	424,009	2022/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	6,950	6,901	757,277	2019/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,200	2,187	240,005	2023/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,240	5,300	581,625	2020/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,310	3,431	376,505	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,945	5,944	652,233	2018/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	4,805	5,056	554,756	2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	14,160	14,206	1,558,731	2018/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,380	2,466	270,617	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,990	5,087	558,151	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	380	519	56,957	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	550	719	78,963	2036/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,330	1,524	167,269	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	410	528	58,037	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	350	467	51,263	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	914	100,320	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,870	2,001	219,602	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	720	735	80,645	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	1,279	140,426	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	332	394	43,305	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	2,100	2,346	257,430	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,190	3,408	373,957	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	8,440	8,461	928,416	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,410	2,452	269,092	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,550	3,556	390,265	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,570	1,637	179,660	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,220	3,204	351,584	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,870	4,863	533,582	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,300	2,329	255,626	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,165	1,119	122,800	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,070	1,948	213,740	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	3,020	2,993	328,491	2019/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	948	104,052	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,550	1,532	168,178	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,230	2,268	248,879	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,900	2,873	315,289	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,320	2,342	256,976	2027/02/15
通貨小計	銘柄数 金 額	40銘柄		127,503	130,461	14,314,191	
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	120	146	12,146	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	327	471	39,051	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	170	261	21,654	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	281	419	34,799	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	120	163	13,571	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	820	880	73,003	2020/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	610	794	65,876	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	398	404	33,549	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	230	249	20,642	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,360	2,395	198,591	2019/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	212	226	18,790	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	260	261	21,714	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	759	749	62,088	2021/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	240	228	18,973	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	340	330	27,396	2022/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		7,247	7,984	661,849	
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.2500	550	584	48,653	2019/03/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	750	859	71,613	2021/05/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	800	861	71,723	2020/04/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	630	744	62,001	2022/07/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	463	550	45,820	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	539	649	54,082	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	506	524	43,644	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	410	439	36,572	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	530	566	47,197	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	224	273	22,759	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	518	596	49,646	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	300	307	25,604	2019/10/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	185	205	17,081	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	84	85	7,139	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	958	935	77,892	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	175	163	13,638	2047/03/21
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		7,622	8,346	695,073	
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	228	18,182	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.5000	125	127	10,201	2019/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	270	277	22,106	2021/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	89	95	7,625	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	211	16,816	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	120	136	10,917	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	300	302	24,089	2019/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	100	102	8,201	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	30	32	2,574	2046/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄		1,437	1,514	120,713	

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	
			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	550	606	84,791	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	400	418	58,611	2021/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	320	428	59,903	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	275	290	40,606	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	283	435	60,943	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	275	365	51,145	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	705	1,015	142,085	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	790	890	124,654	2020/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	620	991	138,729	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	331	526	73,619	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	1,305	182,656	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	373	619	86,718	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	780	1,157	161,981	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	540	635	88,976	2022/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,045	1,130	158,194	2019/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	377	668	93,566	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	270	301	42,221	2020/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	742	853	119,364	2021/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	280	300	42,038	2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	255	339	47,514	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	751	760	106,396	2018/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	640	709	99,284	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	578	989	138,394	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	770	1,077	150,758	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	24銘柄		12,858	16,819	2,353,159	
スイス	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	82	119	13,443	2028/04/08
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	120	131	14,860	2020/07/06
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	150	166	18,795	2021/04/28
通貨小計	銘柄数 金 額	3銘柄		352	416	47,099	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,340	3,996	66,175	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,760	1,950	32,292	2019/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,510	1,733	28,712	2021/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	870	958	15,867	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,630	1,843	30,535	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	330	334	5,531	2018/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	600	600	9,950	2027/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		9,040	11,416	189,065	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	770	827	10,783	2019/05/22
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,120	1,245	16,222	2021/05/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,150	1,207	15,733	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,300	1,448	18,870	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	150	154	2,014	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,430	1,441	18,782	2026/02/19
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		5,920	6,324	82,406	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	2,780	3,314	41,795	2020/12/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	870	1,216	15,339	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,450	1,720	21,698	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,534	19,346	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,020	1,204	15,193	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,280	1,352	17,049	2026/11/12
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		8,800	10,342	130,423	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.0000	5,400	5,162	31,592	2019/12/11
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	1,700	1,567	9,594	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	1,240	1,307	8,001	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	4,940	5,811	35,567	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	2,800	2,903	17,771	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	1,250	1,623	9,933	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,930	7,076	43,308	2018/12/13
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	1,500	1,542	9,439	2020/06/11
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	6,700	6,594	40,360	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	2,200	2,333	14,278	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	1,900	1,863	11,405	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	4,750	5,059	30,962	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	3,300	3,508	21,470	2034/11/23
	通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄		44,610	46,353	283,685

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	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	千マレーシア・リンギット 260	千マレーシア・リンギット 264	千円 6,815	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5800	760	763	19,696	2018/09/28
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	400	393	10,154	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	600	599	15,478	2020/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	600	567	14,640	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	150	149	3,868	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	200	200	5,185	2022/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	600	598	15,441	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	130	130	3,356	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	400	400	10,324	2021/11/30
通貨小計	銘柄数 金 額	10銘柄		4,100	4,068	104,962	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	千南アフリカ・ランド 1,210	千南アフリカ・ランド 1,207	10,505	2020/01/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	3,510	3,990	34,713	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	1,200	1,170	10,183	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	2,610	1,882	16,378	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	900	895	7,788	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	2,900	2,668	23,217	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	3,450	3,158	27,482	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	1,150	1,072	9,327	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	3,200	2,981	25,935	2032/03/31
通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄		20,130	19,026	165,533	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 200	千ポーランド・ズロチ 231	6,777	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000	1,120	1,210	35,508	2019/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000	340	334	9,821	2020/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	640	614	18,025	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	1,520	1,483	43,520	2021/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	315	298	8,763	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	150	189	5,557	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	710	762	22,364	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,220	1,233	36,165	2018/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	430	439	12,881	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	10銘柄		6,645	6,797	199,384	
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国債証券	4.4000	千ユーロ 290	千ユーロ 318	39,216	2019/06/18
	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	288	397	48,890	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	260	307	37,831	2020/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	170	208	25,672	2023/03/20
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	100	121	14,958	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	120	138	17,076	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	160	167	20,601	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	120	123	15,225	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	4.5000	190	216	26,686	2020/04/18
国 小 計	銘柄数 金 額	9銘柄		1,698	1,999	246,160	
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	千ユーロ 280	千ユーロ 428	52,738	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	255	401	49,419	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	750	920	113,275	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	300	315	38,824	2018/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	175	197	24,305	2020/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	280	449	55,315	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	192	221	27,305	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	270	341	42,008	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	550	567	69,826	2019/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	220	311	38,356	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	380	434	53,547	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	350	358	44,110	2020/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	220	222	27,350	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	220	224	27,634	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	305	37,595	2022/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	200	206	25,382	2027/07/15
国 小 計	銘柄数 金 額	16銘柄		4,942	5,905	726,998	
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	千ユーロ 350	千ユーロ 365	45,010	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	572	577	71,037	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	260	290	35,708	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	627	77,210	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	334	334	41,221	2047/06/22

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	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	480	491	60,486	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	200	328	40,499	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	200	242	29,793	2022/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	534	609	75,056	2020/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	515	820	100,978	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	730	906	111,549	2022/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	200	216	26,656	2019/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	420	427	52,688	2018/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	500	588	72,466	2024/06/22
国 小 計	銘柄数 金 額	14銘柄		5,890	6,826	840,362	
ユーロ（フランス）				千ユーロ	千ユーロ		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,235	1,829	225,231	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	180	302	37,281	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	930	1,477	181,955	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	872	1,432	176,395	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	650	756	93,101	2021/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	565	852	104,947	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,000	1,276	157,173	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	971	1,035	127,454	2018/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	613	1,000	123,209	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	860	948	116,770	2019/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	500	558	68,697	2020/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,040	1,326	163,256	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	870	958	117,952	2020/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,514	1,755	216,078	2021/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,300	1,510	185,918	2022/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	860	1,045	128,660	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	395	447	55,080	2022/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	290	402	49,551	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	830	922	113,616	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	115	14,206	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	675	695	85,643	2019/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,066	2,484	305,906	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,060	1,187	146,169	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,020	2,072	255,093	2019/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	250	244	30,041	2026/11/25
国 小 計	銘柄数 金 額	25銘柄		21,646	26,637	3,279,393	
ユーロ（ドイツ）				千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	755	1,227	151,162	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	846	1,449	178,445	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	60	99	12,237	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	190	315	38,794	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	610	966	118,956	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	70	117	14,510	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	260	470	57,940	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,210	1,295	159,462	2019/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	734	798	98,244	2019/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	306	462	56,912	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,355	1,518	186,898	2021/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,142	1,269	156,305	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	448	603	74,328	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	400	442	54,448	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	560	639	78,709	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	500	566	69,701	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	400	544	67,073	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	470	524	64,623	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	790	825	101,608	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	883	916	112,833	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	250	246	30,368	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	302	37,279	2018/09/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,440	1,471	181,217	2019/10/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,940	1,997	245,964	2020/10/16
国 小 計	銘柄数 金 額	24銘柄		15,919	19,072	2,348,025	
ユーロ（スペイン）				千ユーロ	千ユーロ		
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	550	809	99,611	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	610	622	76,634	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,095	1,187	146,215	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,000	1,008	124,203	2019/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	469	487	59,984	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,349	1,356	167,040	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	280	420	51,797	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	450	584	71,989	2037/01/31

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	4.6000	1,238	1,365	168,161	2019/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	483	674	82,994	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	100	116	14,388	2020/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	724	880	108,433	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	840	1,063	130,936	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	210	269	33,129	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	888	1,102	135,734	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	140	207	25,589	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	984	1,117	137,608	2024/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,480	1,544	190,196	2020/01/31
国 小 計	銘柄数	18銘柄					
	金 額			12,890	14,821	1,824,649	
ユーロ（イタリア）	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,035	1,475	181,619	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	545	566	69,749	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	820	815	100,433	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	200	194	23,908	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	160	138	17,090	2067/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	340	452	55,739	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,288	1,848	227,576	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	850	1,132	139,468	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	770	924	113,807	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	702	797	98,218	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	220	297	36,606	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	850	1,037	127,760	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,497	1,578	194,363	2018/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,970	3,253	400,481	2019/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	164	219	27,031	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	1,650	1,852	228,071	2020/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,070	1,313	161,704	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	150	169	20,844	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,320	1,556	191,635	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	530	637	78,477	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,670	2,078	255,826	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	130	164	20,223	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	525	684	84,252	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,150	1,388	170,921	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	560	649	79,963	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	370	421	51,836	2030/03/01
国 小 計	銘柄数	26銘柄					
	金 額			21,536	25,648	3,157,614	
ユーロ（フィンランド）	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	80	80	9,849	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	180	183	22,557	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.3750	80	88	10,870	2019/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	262	32,289	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	3.3750	200	222	27,399	2020/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	100	109	13,534	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	90	120	14,869	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	350	398	49,012	2024/04/15
国 小 計	銘柄数	8銘柄					
	金 額			1,280	1,465	180,380	
ユーロ（オーストリア）	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	320	345	42,550	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	320	330	40,645	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	400	400	49,318	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	80	126	15,615	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.9000	280	318	39,217	2020/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	360	420	51,769	2021/09/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	210	325	40,094	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.3500	480	522	64,271	2019/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	260	311	38,368	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	80	138	17,073	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	130	185	22,805	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	230	257	31,665	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	120	147	18,178	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	80	89	10,976	2024/10/21
国 小 計	銘柄数	14銘柄					
	金 額			3,350	3,919	482,551	
通貨小計	銘柄数	154銘柄					
	金 額			89,151	106,296	13,086,136	
合 計	銘柄数	322銘柄					
	金 額					32,433,686	

(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)	51	—
T-NOTE (10YR) (アメリカ)	27	—
T-NOTE (5YR) (アメリカ)	246	—
T-NOTE (2YR) (アメリカ)	261	—
T-BOND (ULTRA LONG) (アメリカ)	91	—
BUND (10YR) (ドイツ)	122	—
BOBL (5YR) (ドイツ)	196	—
国 SCHATZ (2YR) (ドイツ)	179	—
BUXL (30YR) (ドイツ)	83	—
BTP 10YR (イタリア)	50	—
OAT 10YR (フランス)	55	—

(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2016年9月26日 至2017年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	311,261,753円
受取利息	311,881,708
支払利息	△ 619,955
(B) 有価証券売買損益	73,579,262
売買益	2,044,486,776
売買損	△ 1,970,907,514
(C) 先物取引等損益	26,962,229
取引益	71,903,846
取引損	△ 44,941,617
(D) その他費用	△ 5,374,556
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	406,428,688
(F) 解約差損益金	8,396,785
(G) 追加信託差損益金	△ 1,347,755,423
(H) 合計 (E + F + G)	△ 932,929,950
次期繰越損益金 (H)	△ 932,929,950

(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

2017年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	32,433,686	93.8
コール・ローン等、その他	2,161,088	6.2
投資信託財産総額	34,594,774	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=109.72円、1カナダ・ドル=82.89円、1オーストラリア・ドル=83.28円、1シンガポール・ドル=79.70円、1イギリス・ポンド=139.91円、1スイス・フラン=112.97円、1デンマーク・クローネ=16.56円、1ノルウェー・クローネ=13.03円、1スウェーデン・クローネ=12.61円、1メキシコ・ペソ=6.12円、1マレーシア・リンギット=25.80円、1南アフリカ・ランド=8.70円、1ポーランド・ズロチ=29.33円、1ユーロ=123.11円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (32,888,862千円) の投資信託財産総額 (34,594,774千円) に対する比率は、95.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	67,257,757,690円
コール・ローン等	1,523,893,654
公社債 (評価額)	32,433,686,304
未収入金	32,964,858,789
未取利息	184,791,560
前払費用	83,164,813
差入委託証拠金	67,362,570
(B) 負債	32,696,952,040
未払金	32,696,952,040
(C) 純資産総額 (A - B)	34,560,805,650
元本	35,493,735,600
次期繰越損益金	△ 932,929,950
(D) 受益権総口数	35,493,735,600口
1万口当り基準価額 (C/D)	9,737円

* 設定時における元本額は99,800,000円、当期中における追加設定元本額は35,619,931,355円、同解約元本額は225,995,755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) 34,623,272,579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) 849,644,497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) 20,818,524円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,737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932,929,950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1期

(決算日 2017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1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

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

<2735>

設定以来の運用実績

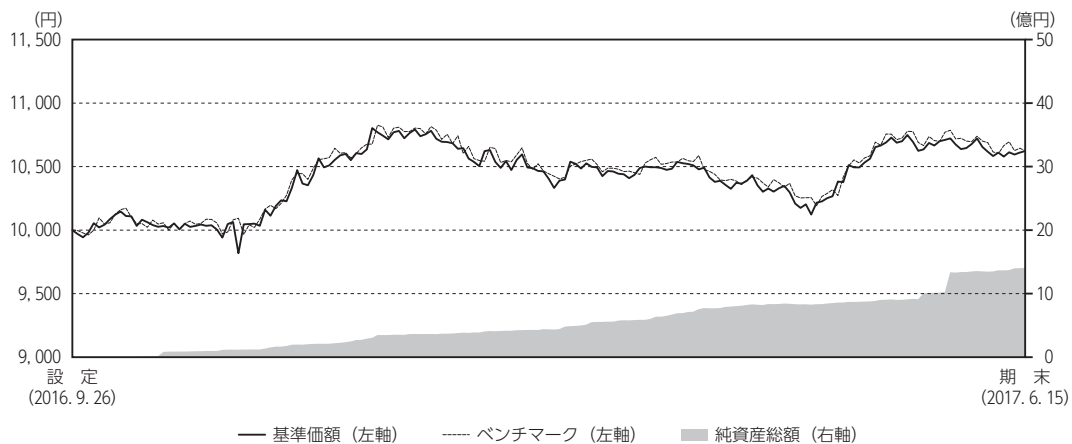
決算期	基準価額			シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率				
1 期末 (2017年 6月15日)	円 10,622	円 0	% 6.2	% 6.3	% 10,625	% 98.8	% —	百万円 1,404

- (注1) 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、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



(注) ベンチマークは、設定時を10,000として指数化したものです。

*ベンチマークは、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）です。

■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円
 期末：10,622円
 騰落率：6.2%

■ 基準価額の主な変動要因

日本を除く先進国国債に主に投資した結果、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、合計で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		シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%	(9/23)	%	%	%
(設定) 2016年 9月26日	10,000	—	10,000	—	—	—
9月末	10,021	0.2	10,097	1.0	97.8	—
10月末	10,034	0.3	10,086	0.9	97.7	—
11月末	10,433	4.3	10,486	4.9	98.2	—
12月末	10,755	7.6	10,757	7.6	98.4	—
2017年 1月末	10,493	4.9	10,525	5.2	98.2	—
2月末	10,435	4.4	10,452	4.5	98.2	—
3月末	10,433	4.3	10,417	4.2	98.2	—
4月末	10,493	4.9	10,528	5.3	98.7	—
5月末	10,646	6.5	10,701	7.0	98.4	—
(期末) 2017年 6月15日	10,622	6.2	10,625	6.3	98.8	—

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2016. 9. 26 ~ 2017. 6. 15)

■ 外国債券市況

主要国の国債金利は、設定時より、ECB（欧州中央銀行）の資産買い入れの減額観測が出たことなどから上昇しました。また、2016年11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利し、今後の財政拡大などが意識されたことも、さらなる金利上昇の要因となりました。12月に米国で利上げが行われたことで米国の金利は上昇した一方、欧州では金融緩和が継続されたため金利は低下しました。その後、金利は上下に振れながらもおおむねレンジ内での推移となりました。2017年3月中旬以降は、トランプ政権の政策に対する不透明感などから金利はおおむね低下基調で推移しました。

■ 為替相場

為替相場は、設定時より、米国の利上げ観測などを受けて米ドル高が進行しました。その後、2016年11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことや12月の米国の利上げにより金利が上昇し、大きく円安が進みました。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月には欧州の政治リスクが後退したことから円安に転じましたが、5月はトランプ大統領のロシアとの不透明な関係をめぐる疑惑への懸念が高まったことなどから、主に米ドルが下落しました。

ポートフォリオについて

(2016. 9. 26 ~ 2017. 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。

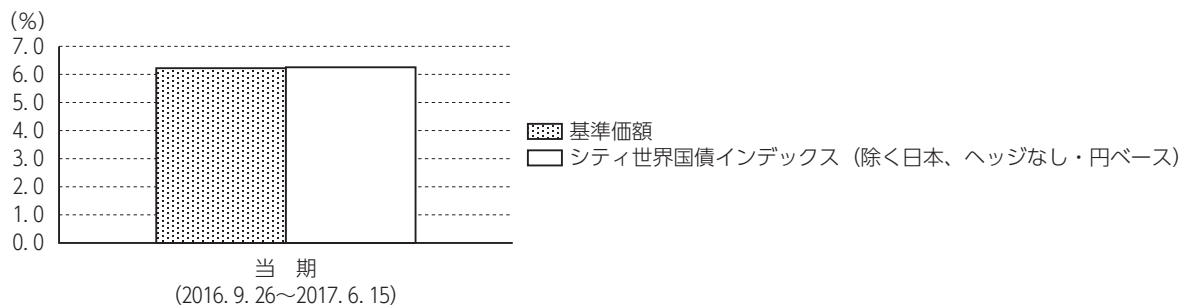
■ 外国債券インデックスマザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

当期のベンチマークの騰落率は6.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は6.2%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。また、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0.06%程度でした。ただし、これはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。



分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2016年9月26日 ～2017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)	621

- (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 (2016.9.26~2017.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	31円	0.296%	信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,421円です。
(投信会社)	(21)	(0.202)	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)	(8)	(0.078)	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)	(0.016)	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/期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
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	0.031	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)	(0.025)	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)	(0.006)	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	34	0.326	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年9月26日から2017年6月15日まで)

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
外国債券インデックスマザーファンド	525,831	1,393,147	2,126	5,751

(注) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	当期末	
	口数	評価額
外国債券インデックスマザーファンド	523,704	1,403,528

(注) 単位未満は切捨て。

■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。

■投信会社(自社)による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
1	—	1	—	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017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	1,403,528	99.8
コール・ローン等、その他	2,269	0.2
投資信託財産総額	1,405,797	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=109.72円、1カナダ・ドル=82.89円、1オーストラリア・ドル=83.28円、1シンガポール・ドル=79.70円、1イギリス・ポンド=139.91円、1スイス・フラン=112.97円、1デンマーク・クローネ=16.56円、1ノルウェー・クローネ=13.03円、1スウェーデン・クローネ=12.61円、1メキシコ・ペソ=6.12円、1マレーシア・リンギット=25.80円、1南アフリカ・ランド=8.70円、1ポーランド・ズロチ=29.33円、1ユーロ=123.11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(159,262,330千円)の投資信託財産総額(159,534,083千円)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

2017年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,405,797,841円
コール・ローン等	2,269,195
外国債券インデックスマザーファンド（評価額）	1,403,528,646
(B) 負債	913,351
未払信託報酬	895,370
その他未払費用	17,981
(C) 純資産総額（A－B）	1,404,884,490
元本	1,322,658,686
次期繰越損益金	82,225,804
(D) 受益権総口数	1,322,658,686口
1万口当り基準価額（C/D）	10,622円

*設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は1,394,396,399円、同解約元本額は72,737,713円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,622円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月26日 至2017年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 583円
受取利息	17
支払利息	△ 600
(B) 有価証券売買損益	15,119,055
売買益	16,235,666
売買損	△ 1,116,611
(C) 信託報酬等	△ 1,597,200
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	13,521,272
(E) 追加信託差損益金	68,704,532
（配当等相当額）	（△ 484）
（売買損益相当額）	（ 68,705,016）
(F) 合計（D＋E）	82,225,804
次期繰越損益金（F）	82,225,804
追加信託差損益金	68,704,532
（配当等相当額）	（△ 484）
（売買損益相当額）	（ 68,705,016）
分配準備積立金	13,521,855
繰越損益金	△ 583

（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	13,521,855
(c) 収益調整金	68,705,016
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	82,226,871
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	82,226,871
(h) 受益権総口数	1,322,658,686口

<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（2016年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017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180～191ページに併せて掲載いたしました。

■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2016年9月26日から2017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% 2026/11/15	千円 607, 595	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.625% 2017/8/31	千円 671, 971
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) 0.625% 2017/9/30	558, 858
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3% 2047/2/15	467, 890	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2018/4/30	469, 842
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2027/2/15	446, 563	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.625% 2018/4/30	460, 364
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2020/5/15	439, 814	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) 1.25% 2019/5/31	438, 686	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4.25% 2017/10/25	394, 944
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) 0.75% 2018/2/28	382, 530
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2026/8/15	367, 812	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4% 2018/4/25	379, 171
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2021/10/31	339, 538	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.875% 2018/5/15	332, 877
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2021/9/30	338, 838	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.875% 2017/9/30	321, 631

(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、2017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（59,482,440千円）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	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
			千円	%	%	%	%	%
アメリカ	千アメリカ・ドル 616, 458	千アメリカ・ドル 630, 197	千円 69, 145, 298	43.4	—	18.1	17.5	7.7
カナダ	千カナダ・ドル 35, 945	千カナダ・ドル 39, 587	3, 281, 393	2.1	—	0.9	0.6	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 37, 481	千オーストラリア・ドル 40, 678	3, 387, 742	2.1	—	1.4	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 7, 388	千シンガポール・ドル 7, 792	621, 067	0.4	—	0.2	0.1	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 62, 478	千イギリス・ポンド 81, 304	11, 375, 352	7.1	—	5.2	1.5	0.4
スイス	千スイス・フラン 2, 187	千スイス・フラン 2, 635	297, 785	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 46, 136	千デンマーク・クローネ 58, 035	961, 063	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 32, 177	千ノルウェー・クローネ 34, 385	448, 042	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 51, 650	千スウェーデン・クローネ 59, 476	749, 994	0.5	—	0.2	0.2	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 232, 260	千メキシコ・ペソ 242, 229	1, 482, 444	0.9	—	0.5	0.3	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 26, 234	千マレーシア・リンギット 26, 402	681, 194	0.4	—	0.3	0.1	0.0
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 111, 523	千南アフリカ・ランド 103, 925	904, 149	0.6	—	0.5	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 34, 924	千ポーランド・ズロチ 35, 860	1, 051, 779	0.7	—	0.3	0.3	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ 8, 886	千ユーロ 10, 245	1, 261, 318	0.8	—	0.4	0.3	0.1
	千ユーロ 23, 198	千ユーロ 27, 911	3, 436, 219	2.2	—	1.5	0.5	0.2
	千ユーロ 26, 687	千ユーロ 33, 011	4, 064, 045	2.5	—	1.9	0.5	0.2
	千ユーロ 106, 359	千ユーロ 127, 216	15, 661, 641	9.8	—	6.2	2.7	0.9
	千ユーロ 78, 046	千ユーロ 92, 879	11, 434, 422	7.2	—	4.2	1.9	1.0
	千ユーロ 61, 348	千ユーロ 72, 526	8, 928, 701	5.6	—	3.5	1.5	0.6

外国債券インデックスマザーファンド

作成期		2017年6月15日現在							
区分	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	
ユーロ圏	イタリア	千ユーロ 108,029	千ユーロ 123,743	15,234,010	9.6	—	5.7	2.8	1.1
	フィンランド	千ユーロ 6,988	千ユーロ 7,840	965,222	0.6	—	0.4	0.2	0.0
	オーストリア	千ユーロ 15,683	千ユーロ 19,029	2,342,782	1.5	—	0.9	0.4	0.1
	小計	千ユーロ 435,224	千ユーロ 514,404	63,328,365	39.7	—	24.6	10.8	4.3
合計	—	—	157,715,672	98.9	—	52.8	32.5	13.7	

(注1) 邦貨換算金額は、2017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力しています。

(2) 外国(外貨建) 公社債(銘柄別)

2017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		
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.0000	千アメリカ・ドル 3,173	千アメリカ・ドル 3,275	千円 359,358	2018/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,488	2,573	282,333	2018/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,161	3,236	355,100	2019/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,096	3,202	351,409	2019/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	2,621	2,749	301,650	2019/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,020	4,211	462,109	2019/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,280	4,529	497,021	2020/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,073	3,253	356,964	2020/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,854	2,953	324,075	2020/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,509	4,673	512,735	2020/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,076	4,373	479,816	2021/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,697	295,989	2021/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,322	1,336	146,619	2018/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,065	1,077	118,211	2018/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,341	1,355	148,754	2018/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,582	283,371	2021/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,444	3,452	378,820	2018/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,835	2,839	311,566	2018/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,320	1,329	145,842	2018/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,183	239,602	2021/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,165	2,167	237,831	2018/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,861	1,863	204,499	2018/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,426	1,424	156,319	2019/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,268	358,601	2022/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,843	1,844	202,379	2019/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	300	300	33,020	2019/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	559	558	61,234	2019/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,461	270,117	2022/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,385	2,375	260,648	2019/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,368	1,358	149,094	2019/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,784	1,766	193,788	2019/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,525	277,142	2022/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,872	1,857	203,767	2019/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,215	2,196	240,998	2019/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	884	881	96,696	2019/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,168	3,139	344,426	2022/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,353	1,340	147,064	2019/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,894	1,880	206,371	2019/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,366	1,364	149,742	2020/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,392	481,978	2023/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,968	1,958	214,907	2020/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,160	1,149	126,165	2020/03/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,658	511,103	2023/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,451	1,437	157,735	2020/04/30		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	3,407	3,399	372,997	2018/05/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,461	2,453	269,218	2020/05/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,693	1,695	186,001	2018/06/30		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,131	2,155	236,534	2020/06/30		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,827	2,869	314,831	2020/07/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,697	1,698	186,382	2018/07/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,768	2,869	314,853	2023/08/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,993	2,030	222,772	2020/08/31		

2017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	2.0000	1,885	1,913	209,924	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,611	3,610	396,167	2018/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,345	2,362	259,202	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,283	579,694	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,638	2,636	289,270	2018/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,501	2,539	278,588	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,026	2,032	223,021	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,006	2,062	226,322	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,499	603,353	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,185	2,192	240,560	2019/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,647	1,679	184,223	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,373	2,380	261,157	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,734	1,760	193,152	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,383	2,396	262,911	2019/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,821	2,888	316,967	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	5,412	5,608	615,371	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,975	2,991	328,176	2019/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,407	2,463	270,326	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,241	2,247	246,639	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,732	2,771	304,062	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,885	2,900	318,295	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,485	3,552	389,811	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.8750	904	1,018	111,712	2019/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.1250	724	828	90,946	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.7500	642	785	86,178	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,671	293,096	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	822	90,211	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,122	123,177	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.5000	630	866	95,114	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	971	106,604	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	929	101,962	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	964	105,828	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	473	620	68,082	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	964	1,396	153,196	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,241	1,695	186,010	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,926	2,520	276,515	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	547	761	83,530	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	708	77,685	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	681	74,824	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	849	973	106,775	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,423	156,205	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	760	997	109,451	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,561	171,281	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,710	2,282	250,459	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,478	1,909	209,471	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,591	1,917	210,362	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,869	205,099	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,754	2,393	262,631	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,769	194,136	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,367	1,618	177,581	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,552	170,354	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,737	190,596	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,853	1,938	212,744	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,731	1,730	189,836	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,030	3,025	331,903	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,026	2,164	237,435	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,998	4,081	447,806	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,314	3,855	423,066	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	3,581	4,257	467,096	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,617	4,214	462,398	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,657	4,085	448,296	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,326	3,344	366,950	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,901	318,402	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,162	5,302	581,768	2024/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,729	3,984	437,143	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,989	3,005	329,783	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,318	144,651	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,404	3,433	376,695	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,693	405,220	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,190	3,198	350,906	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,193	240,680	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	6,025	661,118	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,696	3,858	423,392	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,910	319,321	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,325	4,334	475,554	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,228	354,194	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,204	2,215	243,087	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,963	3,944	432,781	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,427	2,403	263,710	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,735	629,283	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,763	3,555	390,135	2045/02/15

外国債券インデックスマザーファンド

2017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	2,788	2,782	305,299	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,809	1,812	198,870	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,792	2,785	305,667	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,894	317,619	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,822	638,876	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,035	4,208	461,739	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,607	2,600	285,324	2020/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,612	286,588	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,844	312,127	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,013	3,014	330,738	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,196	2,193	240,670	2018/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,001	3,012	330,527	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,871	315,103	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,189	2,180	239,228	2018/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,135	3,145	345,152	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,205	241,936	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,143	6,113	670,741	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,573	3,636	399,011	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	14	13	1,531	2018/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,457	269,646	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,868	2,854	313,201	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,179	2,172	238,341	2018/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,468	270,845	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,876	2,860	313,875	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,057	2,047	224,608	2018/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,915	649,069	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,116	3,098	339,990	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	3,866	424,181	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,568	281,780	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,138	2,136	234,442	2018/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,102	340,460	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,687	2,713	297,765	2022/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,151	2,150	235,941	2018/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	3,062	335,964	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,492	2,532	277,884	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,146	2,141	234,915	2019/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,126	3,103	340,518	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,366	5,164	566,679	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,065	2,046	224,562	2019/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,551	279,939	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,428	3,229	354,286	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,100	2,088	229,195	2019/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,309	3,253	356,993	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,262	2,221	243,744	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,962	325,094	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	2,083	228,621	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,905	1,889	207,292	2019/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,029	5,792	635,504	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,428	266,461	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,044	224,333	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	3,221	353,446	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,507	2,485	272,691	2019/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	4,000	3,986	437,352	2018/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,674	293,441	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,468	270,827	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,100	2,080	228,278	2019/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,000	993	109,012	2018/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,450	268,814	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,917	320,108	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,469	270,901	2019/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,600	5,310	582,696	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	3,098	339,973	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,467	270,709	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,200	2,186	239,882	2018/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,619	397,174	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	1,770	1,760	193,134	2018/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,622	397,463	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,680	294,083	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,329	255,591	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,600	2,571	282,139	2019/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	3,000	2,980	327,010	2018/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,429	266,559	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	2,973	326,258	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,147	2,128	233,533	2019/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,326	2,309	253,442	2018/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,500	5,438	596,761	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,945	323,139	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,460	269,927	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,650	3,712	407,358	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,400	1,387	152,208	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,000	995	109,277	2018/11/30

2017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	2.1250	2,490	2,524	277,022	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,400	2,407	264,107	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,440	1,439	157,890	2019/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	2,026	222,319	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,400	1,398	153,480	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,551	279,978	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,500	1,498	164,379	2020/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,700	1,694	185,962	2019/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,040	4,078	447,493	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,032	332,734	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,531	277,716	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,875	4,042	443,532	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,130	2,126	233,327	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,300	2,292	251,576	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,033	332,783	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,328	255,490	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,900	1,909	209,485	2020/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,850	1,847	202,703	2019/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,000	5,058	555,024	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	900	906	99,449	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	850	851	93,374	2020/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,000	2,042	224,085	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	300	313	34,356	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	3,020	331,394	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	3,011	330,368	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	4,004	439,340	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,003	329,518	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,992	438,072	2019/05/31
通貨小計	銘柄数	242銘柄					
	金額			616,458	630,197	69,145,298	
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	325	396	32,895	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	386	617	51,193	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,416	117,392	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,731	143,558	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,192	1,780	147,619	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	969	1,001	82,980	2018/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,524	1,608	133,313	2019/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	1,859	154,148	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,476	1,585	131,406	2020/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	1,037	85,996	2021/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,351	1,456	120,688	2022/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,561	2,033	168,578	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,274	105,622	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,021	1,026	85,070	2018/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,521	126,096	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	853	865	71,779	2019/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,627	1,656	137,338	2019/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,047	1,214	100,680	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,236	102,461	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,719	1,744	144,598	2020/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	931	923	76,560	2020/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,129	1,137	94,290	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,237	1,223	101,452	2021/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,480	1,460	121,067	2021/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,344	1,339	111,018	2018/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,040	991	82,218	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,470	1,463	121,301	2018/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	840	816	67,684	2022/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,620	1,610	133,524	2019/02/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	900	897	74,414	2019/05/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	200	198	16,443	2022/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	460	458	37,995	2019/08/01
通貨小計	銘柄数	32銘柄					
	金額			35,945	39,587	3,281,393	
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.2500	2,455	2,607	217,171	2019/03/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,774	231,072	2021/05/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,409	2,593	215,977	2020/04/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,162	2,554	212,773	2022/07/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,457	204,659	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,119	259,775	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,473	2,561	213,305	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,314	1,407	117,211	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,398	2,564	213,545	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,108	1,351	112,578	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,197	1,223	101,883	2018/10/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,848	3,277	272,962	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,011	2,060	171,636	2019/10/21

外国債券インデックスマザーファンド

2017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	
			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	863	956	79,685	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	557	542	45,141	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,195	2,190	182,443	2020/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	412	420	35,017	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,142	2,199	183,139	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,278	1,247	103,910	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	682	638	53,152	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	700	702	58,490	2021/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,200	1,227	102,207	2028/11/21
通貨小計	銘柄数	22銘柄					
	金 額			37,481	40,678	3,387,742	
				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	4.0000	491	507	40,478	2018/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	696	736	58,688	2020/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	867	69,145	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	469	37,456	2022/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.5000	599	613	48,883	2019/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	503	539	43,035	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	359	384	30,662	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	495	508	40,528	2021/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	430	34,271	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	491	518	41,284	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	238	271	21,652	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	125	134	10,694	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	415	418	33,323	2019/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	124	127	10,169	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	224	228	18,186	2020/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	228	245	19,564	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	250	252	20,114	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	190	188	14,994	2021/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	201	16,068	2022/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	150	148	11,862	2036/08/01
通貨小計	銘柄数	20銘柄					
	金 額			7,388	7,792	621,067	
				千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,280	2,411	337,432	2020/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,121	2,337	326,987	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,594	362,949	2021/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,182	1,581	221,269	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,175	1,240	173,501	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	60	60	8,453	2022/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	460	443	62,106	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	200	204	28,583	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	350	370	51,857	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	210	214	30,053	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,445	202,285	2021/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,460	204,366	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,590	2,212	309,504	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,956	273,766	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,032	2,927	409,530	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,457	2,289	320,328	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,724	1,944	272,030	2020/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	3,038	425,121	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,086	3,336	466,759	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,638	229,302	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,666	2,648	370,543	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,590	2,287	320,026	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,373	2,281	319,206	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,573	1,693	236,892	2019/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,246	1,849	258,754	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,232	1,450	202,999	2022/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,870	2,727	381,668	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,428	1,545	216,174	2019/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,244	2,206	308,743	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,795	2,006	280,697	2020/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,372	331,883	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,633	1,877	262,698	2021/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,352	2,134	298,586	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,405	336,608	2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,156	2,871	401,732	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	2,854	2,889	404,334	2018/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,942	2,153	301,266	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,621	2,769	387,523	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,251	2,329	325,897	2019/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,842	2,123	297,067	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	2,972	415,858	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	41銘柄					
	金 額			62,478	81,304	11,375,352	

2017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		
スイス	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	千スイス・フラン 404	千スイス・フラン 511	千円 57,732	2023/02/11	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	497	721	81,482	2028/04/08	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	517	555	62,809	2019/05/12	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	407	446	50,401	2020/07/06	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	362	401	45,359	2021/04/28	
合 計	銘柄数	5銘柄						
	金 額			2,187	2,635	297,785		
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 11,512	千デンマーク・クローネ 19,659	325,559	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	8,601	9,529	157,812	2019/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	8,050	9,243	153,069	2021/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,337	88,386	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	8,363	9,460	156,665	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,164	3,202	53,036	2018/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,600	1,602	26,533	2027/11/15	
	通貨小計	銘柄数	7銘柄					
	金 額			46,136	58,035	961,063		
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千ノルウェー・クローネ 7,075	千ノルウェー・クローネ 7,604	99,081	2019/05/22	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,998	7,779	101,361	2021/05/25	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,824	5,065	65,997	2023/05/24	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,561	59,441	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,499	45,597	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,366	43,870	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,450	2,509	32,692	2027/02/17	
	通貨小計	銘柄数	7銘柄					
	金 額			32,177	34,385	448,042		
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 10,843	136,737	2020/12/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	8,385	9,119	115,000	2019/03/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	5,809	73,259	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	10,045	126,672	2022/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,698	97,078	2023/11/13	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,895	6,963	87,812	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,680	5,999	75,655	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,950	2,995	37,776	2028/05/12	
	通貨小計	銘柄数	8銘柄					
		金 額			51,650	59,476	749,994	
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 20,502	125,473	2019/12/11	
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	10,090	9,304	56,946	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	3,500	3,838	23,490	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	10,633	11,210	68,610	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	22,119	26,021	159,254	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	10,668	11,063	67,710	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,874	8,925	54,626	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	8,844	9,895	60,560	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	22,092	22,559	138,062	2018/12/13	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	9,694	11,084	67,834	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	14,128	14,527	88,905	2020/06/11	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	27,826	27,389	167,621	2021/06/10	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	13,802	84,470	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	13,099	12,848	78,629	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	14,654	15,607	95,520	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	4.7500	16,633	16,265	99,545	2018/06/14	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	6,944	7,382	45,178	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数	17銘柄						
	金 額			232,260	242,229	1,482,444		
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 677	17,466	2019/07/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	573	546	14,088	2027/05/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.2480	738	812	20,967	2028/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	1,603	1,638	42,280	2019/11/29	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,196	30,878	2030/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,916	1,953	50,398	2021/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,553	40,076	2026/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	650	640	16,537	2031/06/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5800	895	899	23,194	2018/09/28	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	864	22,298	2022/08/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	719	18,557	2027/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1270	618	599	15,466	2032/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,044	1,043	26,932	2020/03/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	983	25,385	2023/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	477	451	11,639	2033/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	586	561	14,486	2028/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8890	656	662	17,086	2020/07/31	

外国債券インデックスマザーファンド

2017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	
			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	614	15,855	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,079	27,849	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	857	871	22,474	2021/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6540	648	651	16,807	2019/10/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	737	736	19,009	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	700	702	18,121	2020/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,166	30,102	2022/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	820	802	20,707	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7590	768	773	19,965	2019/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	702	700	18,066	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	630	630	16,268	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	50	50	1,294	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	352	9,085	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	500	507	13,081	2022/03/10
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	600	609	15,712	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	350	350	9,052	2027/11/16
通貨小計	銘柄数	33銘柄					
	金 額			26,234	26,402	681,194	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	4,178	4,217	36,689	2018/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	5,768	5,756	50,080	2020/01/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	15,434	17,544	152,640	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	7,612	5,559	48,367	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	4,622	4,508	39,224	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	8,904	6,422	55,875	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	8,999	7,602	66,138	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	5,539	5,509	47,931	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	13,452	12,379	107,699	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	8,621	7,893	68,675	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	8,862	8,262	71,879	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	6,944	6,391	55,606	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	6,243	5,815	50,599	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	4,166	3,983	34,658	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	2,179	2,078	18,082	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			111,523	103,925	904,149	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	2,309	2,667	78,247	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000	1,912	2,066	60,617	2019/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000	2,478	2,440	71,582	2020/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,377	3,242	95,110	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,127	2,100	61,617	2021/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	2,758	2,697	79,116	2018/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	3,051	2,978	87,356	2021/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,820	1,726	50,631	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	1,620	1,600	46,953	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	400	386	11,345	2019/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,044	30,641	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	2,256	2,476	72,639	2020/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	884	1,005	29,482	2021/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,575	2,765	81,109	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,099	2,121	62,222	2018/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,840	1,891	55,489	2019/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,591	2,646	77,616	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	17銘柄					
	金 額			34,924	35,860	1,051,779	
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国債証券	4.5000	759	809	99,701	2018/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	4.4000	684	751	92,495	2019/06/18
	IRISH TREASURY	国債証券	5.9000	570	655	80,693	2019/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,131	1,559	191,995	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	765	904	111,313	2020/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	504	618	76,112	2023/03/20
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	737	90,798	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	761	879	108,295	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	540	66,579	2022/03/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	531	555	68,369	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	673	693	85,391	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	350	359	44,198	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	4.5000	1,035	1,180	145,372	2020/04/18
国小計	銘柄数	13銘柄					
	金 額			8,886	10,245	1,261,318	
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	788	97,019	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,239	1,895	233,368	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,355	2,133	262,602	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	970	119,467	2023/01/15

2017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	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,544	1,623	199,817	2018/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,347	1,479	182,131	2019/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,146	1,292	159,168	2020/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,349	2,164	266,501	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,463	1,690	208,062	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,630	200,669	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,476	181,723	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,549	190,720	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	924	952	117,308	2019/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,084	1,535	188,994	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,732	213,345	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,374	1,406	173,167	2020/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,291	1,303	160,498	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,338	1,365	168,066	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	407	50,126	2022/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	500	515	63,457	2027/07/15
国小計	銘柄数	20銘柄					
	金 額			23,198	27,911	3,436,219	
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,461	179,912	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	924	932	114,753	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	558	622	76,635	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,283	1,352	166,488	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	544	545	67,138	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	290	314	38,695	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	150	152	18,765	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	600	614	75,607	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	250	256	31,595	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	260	292	35,995	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	300	309	38,152	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,600	320,200	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,802	345,055	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	1,377	1,666	205,128	2022/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	1,121	1,213	149,455	2019/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	1,736	1,981	244,002	2020/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,674	2,666	328,229	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,738	213,967	2021/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,370	168,698	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,633	201,095	2022/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	680	972	119,685	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	1,123	1,215	149,673	2019/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,532	188,691	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	1,052	1,071	131,972	2018/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	753	1,140	140,387	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,771	218,123	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	597	779	95,935	2034/06/22
国小計	銘柄数	27銘柄					
	金 額			26,687	33,011	4,064,045	
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	653	794	97,752	2019/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	985	1,488	183,244	2023/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,225	3,296	405,781	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,623	4,054	499,101	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,007	5,058	622,810	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,709	4,305	530,019	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,075	3,353	412,823	2019/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,564	2,569	316,378	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,230	3,757	462,640	2021/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,424	3,657	450,251	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,697	4,719	581,069	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,567	2,736	336,947	2018/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,734	4,463	549,518	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,263	3,598	443,047	2019/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,380	3,772	464,393	2020/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,017	1,711	210,756	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	4,011	493,851	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,113	3,428	422,052	2020/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,550	4,115	506,656	2021/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,630	4,216	519,142	2022/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,099	3,765	463,628	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	3,051	375,666	2022/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,888	2,620	322,596	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,721	458,161	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,920	1,963	241,758	2018/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,086	3,561	438,413	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,264	2,333	287,255	2019/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,787	3,351	412,662	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,799	3,135	385,969	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,322	2,381	293,230	2019/11/25

外国債券インデックスマザーファンド

2017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	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,792	2,849	350,851	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,070	3,116	383,639	2020/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,101	2,220	273,345	2025/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,193	2,247	276,629	2020/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,720	2,918	359,270	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,592	1,607	197,951	2019/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,737	2,757	339,445	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,079	1,078	132,757	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	587	580	71,465	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,170	2,204	271,409	2021/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,342	288,399	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,114	137,182	2022/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	620	665	81,970	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	710	87,430	2020/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	900	936	115,266	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	800	869	107,044	2048/05/25
国小計	銘柄数	46銘柄					
	金 額			106,359	127,216	15,661,641	
ユーロ (ドイツ)				千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,174	1,674	206,188	2024/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,567	2,548	313,736	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,121	261,220	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,406	173,158	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,629	200,592	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,398	295,335	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	2,943	362,420	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,071	3,280	403,865	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	2,062	253,930	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,211	2,328	286,625	2018/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,399	2,532	311,762	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	2,682	2,871	353,452	2019/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,481	2,697	332,076	2019/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,075	2,286	281,532	2020/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,928	2,147	264,331	2020/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,474	2,226	274,148	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,444	1,580	194,584	2020/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,595	319,504	2021/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,937	238,526	2021/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,585	195,174	2021/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,707	1,904	234,479	2022/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,470	304,125	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,728	2,328	286,697	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,810	222,846	2022/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,559	191,929	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	2,013	247,905	2023/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,825	224,744	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,767	217,609	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,959	2,668	328,491	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,780	219,169	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,670	205,603	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,394	2,501	307,911	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,534	1,661	204,580	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,168	2,250	277,036	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	2,812	346,197	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,000	1,002	123,419	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,510	186,018	2018/06/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	706	86,984	2018/09/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	950	960	118,250	2018/12/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	405	49,863	2019/03/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	405	49,936	2019/06/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,209	1,237	152,306	2018/10/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,438	1,480	182,252	2019/02/22
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,113	1,137	140,056	2019/04/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,151	1,176	144,848	2019/10/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,731	1,765	217,305	2020/04/17
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,448	1,491	183,586	2020/10/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,578	1,613	198,683	2021/04/09
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,739	214,100	2021/10/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	360	368	45,315	2022/04/08
国小計	銘柄数	50銘柄					
	金 額			78,046	92,879	11,434,422	
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	2,871	353,530	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,745	1,830	225,329	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,552	1,583	194,977	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,792	1,943	239,285	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1500	1,250	1,302	160,378	2020/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,846	227,356	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,672	1,686	207,667	2019/01/31

2017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	0.7500	1,147	1,183	145,742	2021/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	852	885	108,969	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	400	436	53,689	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,730	1,740	214,217	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	580	586	72,154	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,822	224,330	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	550	569	70,149	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	2,973	366,097	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,654	2,149	264,603	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,428	2,036	250,766	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1000	2,206	2,316	285,184	2018/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	2,136	263,038	2024/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6000	2,382	2,628	323,555	2019/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3000	1,775	1,967	242,175	2019/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,373	1,916	235,923	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,101	2,355	289,971	2020/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	1,789	2,295	282,641	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,681	1,964	241,872	2020/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,515	3,059	376,673	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,760	339,863	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,504	308,324	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,608	3,342	411,436	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,601	1,987	244,720	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,270	1,745	214,918	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,754	1,855	228,385	2018/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,049	1,557	191,735	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,836	1,941	239,024	2019/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,376	292,584	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,382	293,256	2024/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	1,983	244,170	2020/01/31
国小計	銘柄数	37銘柄					
	金額			61,348	72,526	8,928,701	
ユーロ (イタリア)				千ユーロ	千ユーロ		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,639	201,826	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,638	201,671	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,409	419,741	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,944	239,333	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0500	1,445	1,482	182,496	2019/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,429	1,485	182,885	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,681	207,069	2022/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,678	206,623	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,765	1,622	199,738	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,511	1,536	189,116	2020/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,591	1,634	201,168	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,554	191,410	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3000	1,171	1,180	145,294	2018/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	774	785	96,754	2020/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,440	1,340	165,030	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,259	1,260	155,223	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,286	1,272	156,644	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	812	816	100,523	2019/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,674	1,680	206,865	2021/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	924	875	107,795	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,568	1,496	184,291	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	700	679	83,681	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,351	166,335	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	448	388	47,853	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	858	859	105,809	2019/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	900	895	110,226	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,060	1,086	133,772	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	310	38,166	2024/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	350	358	44,170	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	120	120	14,855	2020/06/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,654	3,534	435,098	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,088	503,389	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,455	2,069	254,805	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,074	2,223	273,780	2019/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,921	2,145	264,086	2020/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,098	2,796	344,241	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,890	3,469	427,148	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	3,107	382,519	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,734	2,343	288,527	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,748	338,339	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,187	2,306	283,950	2018/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,708	2,925	360,199	2019/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,531	2,772	341,286	2019/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,655	326,877	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,043	2,735	336,736	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,560	2,849	350,859	2020/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,214	2,485	306,031	2020/09/01

外国債券インデックスマザーファンド

2017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	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,541	312,831	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,420	297,931	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,689	331,152	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,419	297,917	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	2,057	253,294	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,910	2,376	292,591	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,810	2,287	281,573	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,272	279,722	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,770	1,836	226,115	2018/06/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,363	1,776	218,734	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,648	326,087	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,111	2,226	274,085	2018/12/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,729	1,955	240,801	2021/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.5000	1,100	1,154	142,163	2019/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,552	314,284	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,938	2,205	271,512	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,708	210,371	2021/12/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	1.5000	1,246	1,288	158,587	2019/08/01
国小計	銘柄数	65銘柄					
	金 額			108,029	123,743	15,234,010	
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国債証券	0.3750	432	444	54,728	2020/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	414	50,971	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	294	36,237	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	411	418	51,505	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	200	24,730	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	270	274	33,743	2022/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.3750	416	459	56,525	2019/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	874	107,683	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	3.3750	632	703	86,581	2020/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	3.5000	459	529	65,165	2021/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	482	59,390	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	612	672	82,828	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	489	60,281	2023/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	546	67,242	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	425	434	53,529	2018/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	601	74,078	2024/04/15
国小計	銘柄数	16銘柄					
	金 額			6,988	7,840	965,222	
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国債証券	0.2500	527	537	66,190	2019/10/18
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	942	116,083	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	576	594	73,162	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	234	240	29,604	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	300	301	37,138	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	380	380	46,852	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	985	1,561	192,263	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.9000	1,248	1,419	174,796	2020/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,561	192,267	2021/09/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,073	1,664	204,865	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.3500	989	1,075	132,426	2019/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,225	150,917	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	951	117,132	2022/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	1,045	128,682	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	318	551	67,867	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	1.9500	738	776	95,547	2019/06/18
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	887	109,288	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,072	132,032	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	621	764	94,072	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.1500	426	436	53,710	2018/10/19
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,038	127,880	2024/10/21
国小計	銘柄数	21銘柄					
	金 額			15,683	19,029	2,342,782	
通貨小計	銘柄数	295銘柄					
	金 額			435,224	514,404	63,328,365	
合 計	銘柄数	761銘柄					
	金 額					157,715,672	

(注1) 邦貨換算金額は、2017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17期 (決算日 2016年11月30日)

(計算期間 2015年12月1日～2016年11月30日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をシティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の公社債
運用方法	①主として外国の公社債に投資し、投資成果をシティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
株式組入制限	純資産総額の30%以下

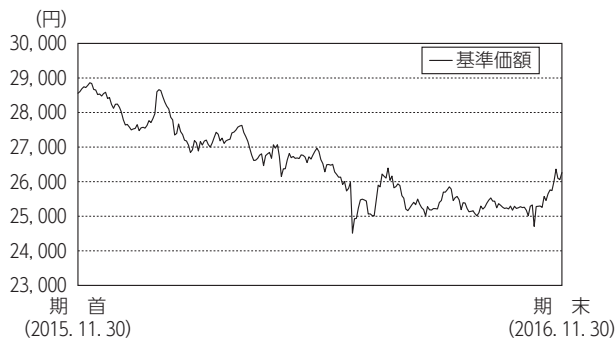
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



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

- (注1) 騰落率は期首比。
 (注2) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。
 (注3) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) の原データに基づき、当ファンドの設定日を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：28,558円 期末：26,265円 騰落率：△8.0%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外債券市況

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

○為替相場

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

【今後の運用方針】

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

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	一円
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

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

		買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	千アメリカ・ドル 166,210	千アメリカ・ドル 128,162 (—)
	カナダ	千カナダ・ドル 12,460	千カナダ・ドル 10,154 (—)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 9,620	千オーストラリア・ドル 3,697 (—)
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,829	千シンガポール・ドル 1,388 (—)
	イギリス	千イギリス・ポンド 8,434	千イギリス・ポンド 6,828 (—)
	スイス	千スイス・フラン 5,245	千スイス・フラン 5,834 (—)
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 12,826	千デンマーク・クローネ 9,788 (—)
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 7,367	千ノルウェー・クローネ 7,757 (—)
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 12,632	千スウェーデン・クローネ 9,024 (—)

		買 付 額	売 付 額
外 国	メキシコ	千メキシコ・ペソ 46,902	千メキシコ・ペソ 29,821 (—)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 6,494	千マレーシア・リンギット 4,204 (—)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 15,233	千南アフリカ・ランド 6,998 (—)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 12,686	千ポーランド・ズロチ 7,040 (—)
	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 1,537	千ユーロ 1,220 (—)
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 4,342	千ユーロ 4,746 (—)
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 4,187	千ユーロ 2,725 (—)
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 23,410	千ユーロ 15,155 (—)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 15,457	千ユーロ 13,726 (—)
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 11,481	千ユーロ 7,816 (—)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 20,618	千ユーロ 14,350 (—)
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 1,494	千ユーロ 1,047 (—)
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 2,880	千ユーロ 2,321 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 85,409	千ユーロ 63,110 (—)

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

■ 主要な売買銘柄
公 社 債

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

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

■組入資産明細表

(1)外国(外貨建) 公社債(通貨別)

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 590,540	千アメリカ・ドル 599,940	千円 67,445,295	43.5%	%	17.6%	17.7%	8.2%	
カナダ	千カナダ・ドル 34,684	千カナダ・ドル 38,441	3,216,825	2.1	—	1.0	0.6	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 34,514	千オーストラリア・ドル 37,263	3,135,370	2.0	—	1.3	0.6	0.2	
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,037	千シンガポール・ドル 7,286	575,419	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
イギリス	千イギリス・ポンド 62,812	千イギリス・ポンド 78,823	11,071,541	7.1	—	5.1	1.6	0.4	
スイス	千スイス・フラン 2,792	千スイス・フラン 3,304	367,180	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 51,791	千デンマーク・クローネ 65,733	1,057,649	0.7	—	0.4	0.2	0.1	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 28,227	千ノルウェー・クローネ 30,237	398,524	0.3	—	0.1	0.1	—	
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 47,400	千スウェーデン・クローネ 55,521	680,141	0.4	—	0.3	0.2	—	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 219,416	千メキシコ・ペソ 225,977	1,231,577	0.8	—	0.4	0.3	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 27,216	千マレーシア・リンギット 26,495	667,167	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 104,423	千南アフリカ・ランド 94,587	766,157	0.5	—	0.4	0.1	—	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 31,114	千ポーランド・ズロチ 31,602	852,954	0.6	—	0.2	0.3	0.1	
ユ	アイルランド	千ユーロ 8,336	千ユーロ 9,775	1,170,103	0.8	—	0.4	0.3	0.1
	オランダ	千ユーロ 25,028	千ユーロ 30,098	3,602,804	2.3	—	1.4	0.5	0.3
イ	ベルギー	千ユーロ 25,843	千ユーロ 32,303	3,866,730	2.5	—	1.8	0.5	0.2
	フランス	千ユーロ 104,489	千ユーロ 125,253	14,992,864	9.7	—	6.0	2.8	0.9
ロ	ドイツ	千ユーロ 78,396	千ユーロ 94,031	11,255,580	7.3	—	4.2	2.2	0.9
	スペイン	千ユーロ 59,673	千ユーロ 69,975	8,376,016	5.4	—	3.3	1.5	0.6
	イタリア	千ユーロ 105,758	千ユーロ 121,214	14,509,366	9.4	—	5.6	2.9	0.9
	フィンランド	千ユーロ 6,718	千ユーロ 7,626	912,887	0.6	—	0.4	0.2	0.0
	オーストリア	千ユーロ 15,749	千ユーロ 19,264	2,305,937	1.5	—	0.9	0.4	0.1
小計	429,990	509,542	60,992,290	39.4	—	24.1	11.3	4.0	
合 計	—	—	152,458,096	98.4	—	51.4	33.2	13.8	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国(外貨建) 公社債(銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	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			
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	千アメリカ・ドル 1,686	千アメリカ・ドル 1,740	千円 195,662	2017/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,839	3,957	444,847	2018/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	2,960	3,084	346,709	2018/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.0000	3,173	3,333	374,808	2018/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,488	2,615	294,024	2018/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,161	3,270	367,630	2019/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,096	3,238	364,038	2019/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	2,621	2,784	313,021	2019/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,020	4,256	478,461	2019/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,280	4,573	514,198	2020/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,073	3,278	368,568	2020/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,854	2,960	332,827	2020/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,372	2,394	269,190	2017/10/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,509	4,679	526,027	2020/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	883	895	100,634	2017/11/30		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	924	941	105,884	2017/12/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	255	259	29,224	2018/01/31		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,076	4,397	494,377	2021/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,234	1,261	141,836	2018/02/28		

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		額	
					外 貨 建 金 額	千 円		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,300	1,332	149,827	2018/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	260	266	29,906	2018/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,702	303,763	2021/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,322	1,349	151,665	2018/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,065	1,088	122,313	2018/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,341	1,368	153,833	2018/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,570	288,954	2021/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,444	3,469	390,078	2018/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,835	2,849	320,377	2018/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,320	1,336	150,237	2018/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,169	243,911	2021/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,165	2,176	244,691	2018/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,861	1,870	210,316	2018/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,426	1,429	160,673	2019/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,244	364,790	2022/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,843	1,851	208,176	2019/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	300	302	33,974	2019/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	559	559	62,913	2019/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,436	273,955	2022/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,385	2,378	267,440	2019/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,368	1,359	152,810	2019/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,784	1,765	198,471	2019/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,497	280,723	2022/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,872	1,856	208,756	2019/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,215	2,195	246,831	2019/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,648	2,646	297,488	2017/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	884	882	99,165	2019/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,168	3,099	348,464	2022/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	2,336	2,330	262,016	2017/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,353	1,338	150,522	2019/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	1,913	1,910	214,739	2017/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,894	1,879	211,258	2019/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,153	2,151	241,916	2018/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,366	1,364	153,415	2020/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,850	3,840	431,765	2023/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	3,447	3,439	386,616	2018/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,968	1,956	219,979	2020/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,315	2,308	259,518	2018/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,160	1,147	128,994	2020/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,591	516,153	2023/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	4,218	4,196	471,778	2018/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,451	1,433	161,196	2020/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	3,407	3,407	383,041	2018/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,461	2,449	275,390	2020/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,693	1,702	191,389	2018/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,131	2,156	242,458	2020/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,827	2,870	322,724	2020/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,697	1,706	191,848	2018/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,768	3,863	434,285	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,993	2,031	228,375	2020/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,885	1,912	215,022	2020/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,611	3,622	407,215	2018/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,345	2,356	264,900	2020/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,228	587,784	2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,638	2,645	297,453	2018/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,501	2,534	284,873	2020/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,026	2,042	229,575	2018/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,006	2,062	231,855	2020/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,443	611,998	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,185	2,201	247,516	2019/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,647	1,676	188,453	2021/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,373	2,390	268,773	2019/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,734	1,754	197,281	2021/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,383	2,407	270,637	2019/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,821	2,882	324,072	2021/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	5,412	5,536	622,434	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,975	3,004	337,793	2019/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,407	2,459	276,512	2021/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,241	2,256	253,643	2019/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,732	2,761	310,463	2021/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,885	2,912	327,422	2019/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,485	3,540	397,993	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.8750	904	1,058	119,023	2019/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.1250	724	855	96,178	2019/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.7500	642	808	90,893	2020/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,721	305,896	2021/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	825	92,827	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,119	125,892	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.5000	630	865	97,256	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	965	108,499	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	919	103,340	2028/08/15	

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	5.2500	738	953	107,142	2028/11/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	473	613	68,923	2029/02/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	964	1,382	155,413	2030/05/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,241	1,676	188,451	2031/02/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,926	2,477	278,465	2036/02/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	547	747	84,029	2037/05/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	693	77,969	2038/02/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,019	1,310	147,364	2038/05/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	849	947	106,495	2039/02/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,388	156,041	2039/05/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	760	971	109,261	2039/08/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,522	171,150	2039/11/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,710	2,227	250,374	2040/02/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,478	1,860	209,174	2040/05/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,591	1,862	209,418	2040/08/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,815	204,120	2040/11/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,754	2,328	261,715	2041/02/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,720	193,411	2041/05/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,367	1,569	176,405	2041/08/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,500	168,675	2041/11/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,680	188,871	2042/02/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,853	1,875	210,803	2042/05/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,731	1,672	188,015	2042/08/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,030	2,922	328,574	2042/11/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,026	2,097	235,805	2043/02/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,998	3,943	443,306	2043/05/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,314	3,756	422,300	2043/08/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	3,581	4,149	466,452	2043/11/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,617	4,098	460,785	2044/02/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,357	3,635	408,732	2044/05/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,326	3,356	377,296	2019/07/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,891	325,094	2021/07/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,662	5,734	644,624	2024/08/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,729	3,856	433,589	2044/08/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,989	3,015	339,000	2019/08/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,312	147,497	2021/08/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,404	3,445	387,308	2019/09/30	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,675	413,219	2021/09/30	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,190	3,204	360,244	2019/10/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,179	244,988	2021/10/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,932	666,883	2024/11/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,696	3,731	419,464	2044/11/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,593	1,593	179,119	2017/11/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,890	324,937	2021/11/30	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,325	4,342	488,132	2019/11/30	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,517	1,518	170,759	2017/12/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,210	360,876	2021/12/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,204	2,220	249,572	2019/12/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,547	1,546	173,838	2018/01/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,963	3,942	443,257	2020/01/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,427	2,382	267,853	2022/01/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,635	633,522	2025/02/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,763	3,424	384,992	2045/02/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,961	1,962	220,636	2018/02/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,788	2,781	312,690	2020/02/29	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,809	1,796	201,921	2022/02/28	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,081	2,082	234,100	2018/03/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,792	2,784	312,991	2020/03/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,083	2,076	233,428	2018/04/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,867	322,363	2022/03/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,180	2,180	245,102	2018/05/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,723	643,464	2025/05/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,035	4,065	457,016	2045/05/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,607	2,597	291,956	2020/04/30	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,588	291,001	2022/04/30	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,816	316,631	2022/05/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,013	3,010	338,453	2020/05/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,196	2,199	247,286	2018/06/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,001	3,009	338,320	2020/06/30	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,847	320,083	2022/06/30	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,189	2,183	245,518	2018/07/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,135	3,140	353,067	2020/07/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,182	245,401	2022/07/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,143	6,005	675,105	2025/08/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,573	3,510	394,615	2045/08/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	14	13	1,572	2018/08/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,431	273,363	2022/08/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,868	2,844	319,825	2020/08/31	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,179	2,176	244,627	2018/09/15	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,439	274,231	2022/09/30	
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,876	2,850	320,413	2020/09/30	

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	
					外 貨 建 金 額	建 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,057	2,049	230,387	2018/10/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,820	654,326	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,116	3,085	346,906	2020/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	3,734	419,830	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,540	285,568	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,138	2,144	241,075	2018/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,277	2,277	256,028	2017/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,092	347,617	2020/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,687	2,684	301,833	2022/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,151	2,156	242,465	2018/12/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	3,051	343,082	2020/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,276	2,278	256,177	2017/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,492	2,505	281,638	2022/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,146	2,145	241,185	2019/01/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,126	3,085	346,891	2021/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,366	5,062	569,071	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,329	2,324	261,281	2018/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,065	2,047	230,160	2019/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,518	283,093	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,428	3,110	349,728	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,100	2,092	235,203	2019/03/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,309	3,230	363,133	2021/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,262	2,188	246,029	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,942	330,785	2021/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	700	699	78,604	2018/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	2,051	230,667	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,125	1,116	125,558	2019/04/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,529	5,207	585,388	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,412	271,168	2021/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,300	4,286	481,834	2018/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,014	226,454	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	3,106	349,187	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,507	2,486	279,511	2019/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	4,000	3,992	448,888	2018/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,657	298,765	2021/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,430	273,208	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,100	2,081	233,969	2019/06/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,000	993	111,738	2018/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,429	273,121	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,868	322,504	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,466	277,303	2019/07/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,600	5,203	584,941	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	2,987	335,805	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,463	276,997	2019/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,200	2,188	245,981	2018/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,589	403,571	2021/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	1,770	1,761	198,026	2018/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,591	403,733	2021/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,634	296,166	2023/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,291	257,558	2023/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,600	2,569	288,807	2019/09/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	3,000	2,982	335,243	2018/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,389	268,652	2023/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	2,946	331,294	2021/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,147	2,126	239,072	2019/10/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,326	2,310	259,781	2018/10/31	
通貨小計	銘柄数	237銘柄						
	金 額			590,540	599,940	67,445,294		
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	389	32,602	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	386	623	52,150	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,419	118,747	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,722	144,165	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,192	1,768	147,961	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	969	1,020	85,417	2018/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,524	1,639	137,169	2019/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,413	1,913	160,140	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,476	1,612	134,893	2020/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	1,053	88,138	2021/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,351	1,471	123,152	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,491	1,929	161,493	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,276	106,794	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,265	1,274	106,657	2018/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,021	1,031	86,307	2018/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,524	127,547	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	853	873	73,071	2019/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,627	1,671	139,894	2019/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	847	972	81,409	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,232	103,104	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	829	847	70,905	2020/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,772	1,784	149,363	2018/02/01	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末			
				額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	931	927	77,617	2020/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,029	1,027	85,973	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,128	1,124	94,083	2017/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,237	1,228	102,812	2021/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,284	1,276	106,821	2018/05/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	980	970	81,231	2021/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,344	1,340	112,143	2018/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	390	366	30,662	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	797	66,721	2018/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	340	330	27,671	2022/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	32銘柄		34,684	38,441	3,216,825	
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.2500	2,455	2,642	222,320	2019/03/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,795	235,185	2021/05/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,209	2,391	201,240	2020/04/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,032	2,406	202,494	2022/07/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,063	2,151	181,056	2018/01/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,450	206,174	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,066	258,016	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,173	2,209	185,929	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,314	1,362	114,641	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,398	2,516	211,714	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	958	1,127	94,871	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,197	1,230	103,500	2018/10/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,848	3,224	271,333	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,511	1,547	130,191	2019/10/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	863	914	76,950	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	557	516	43,458	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,495	1,478	124,420	2020/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	412	400	33,659	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,592	1,589	133,719	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	678	640	53,877	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	682	601	50,611	2047/03/21
通貨小計	銘柄数 金 額	21銘柄		34,514	37,263	3,135,370	
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	4.0000	491	515	40,729	2018/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	696	740	58,497	2020/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	442	485	38,360	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	466	36,864	2022/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.5000	599	617	48,736	2019/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	503	531	41,946	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	359	366	28,948	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	495	507	40,106	2021/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	402	31,745	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	504	500	39,509	2018/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	421	438	34,619	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	238	257	20,354	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	125	128	10,172	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	270	272	21,503	2019/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	224	225	17,804	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	224	228	18,025	2020/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	168	169	13,346	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	250	246	19,449	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	190	186	14,698	2021/10/01
通貨小計	銘柄数 金 額	19銘柄		7,037	7,286	575,419	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,380	2,514	353,215	2020/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,121	2,254	316,624	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,572	361,383	2021/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,182	1,445	202,997	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	945	955	134,181	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	60	58	8,280	2022/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	400	358	50,352	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,470	206,532	2021/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,414	198,705	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,840	2,455	344,845	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,915	269,094	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,032	2,790	391,988	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,457	2,179	306,177	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,724	1,974	277,386	2020/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,856	401,266	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,666	2,512	352,951	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,574	221,188	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,604	1,704	239,378	2018/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,666	2,510	352,647	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,500	2,073	291,257	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,373	2,149	301,967	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,573	1,729	242,971	2019/03/07

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	千円	
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,246	1,758	247,066	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,232	1,445	203,087	2022/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,870	2,611	366,831	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,428	1,568	220,373	2019/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,244	2,061	289,583	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,795	2,020	283,792	2020/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,252	316,420	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,633	1,875	263,478	2021/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,182	1,752	246,196	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,364	332,105	2022/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,156	2,706	380,144	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	2,854	2,908	408,489	2018/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,942	2,110	296,422	2023/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,621	2,536	356,236	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,161	2,250	316,039	2019/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,842	2,068	290,524	2024/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,324	3,056	429,352	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	39銘柄						
	金額			62,812	78,823	11,071,541		
					千スイス・フラン	千スイス・フラン		
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	404	517	57,538	2023/02/11
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	497	728	80,987	2028/04/08
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	605	632	70,223	2018/01/08
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	517	567	63,048	2019/05/12
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	407	452	50,280	2020/07/06
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	362	405	45,102	2021/04/28
通貨小計	銘柄数	6銘柄						
	金額			2,792	3,304	367,180		
					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	7.0000	1,864	2,885	46,427	2024/11/10
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	5,291	5,527	88,940	2017/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	11,512	20,161	324,391	2039/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	8,601	9,762	157,081	2019/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	7,650	8,894	143,117	2021/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,846	6,445	103,712	2023/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	7,863	8,841	142,258	2025/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,164	3,214	51,721	2018/11/15
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金額			51,791	65,733	1,057,649		
					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	6,075	6,635	87,459	2019/05/22
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,698	7,476	98,540	2021/05/25
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,824	5,022	66,196	2023/05/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,535	59,780	2024/03/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,452	45,503	2025/03/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,140	3,114	41,043	2026/02/19
通貨小計	銘柄数	6銘柄						
	金額			28,227	30,237	398,524		
					千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	8,095	9,879	121,018	2020/12/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	8,385	9,345	114,485	2019/03/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	5,826	71,369	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,165	9,832	120,453	2022/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,734	94,752	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,495	6,524	79,921	2025/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	6,080	6,378	78,140	2026/11/12
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金額			47,400	55,521	680,141		
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
		Mexican Bonos	国債証券	5.0000	15,647	14,937	81,411	2019/12/11
		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	7,590	6,799	37,055	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	8,233	8,610	46,926	2023/12/07
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	21,119	24,629	134,232	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	8,568	8,607	46,912	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,756	13,993	76,263	2017/12/14
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,874	8,540	46,543	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	8,844	9,558	52,094	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	22,092	22,897	124,793	2018/12/13
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	9,694	10,562	57,565	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	12,728	13,231	72,112	2020/06/11
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	21,626	21,194	115,508	2021/06/10
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	13,231	72,109	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	11,399	11,089	60,436	2022/06/09
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	14,654	14,801	80,666	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	4.7500	16,633	16,247	88,549	2018/06/14
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	6,944	7,045	38,396	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	17銘柄						
	金額			219,416	225,977	1,231,577		

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
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット			
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2400	1,210	1,213	30,560	2018/02/07		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7340	647	672	16,930	2019/07/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	573	517	13,029	2027/05/31		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.2480	738	770	19,406	2028/09/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	1,603	1,611	40,573	2019/11/29		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,140	28,724	2030/04/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,916	1,912	48,150	2021/07/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,463	36,860	2026/04/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	420	395	9,953	2031/06/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5800	1,595	1,586	39,949	2018/09/28		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	829	20,888	2022/08/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	678	17,073	2027/03/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1270	618	560	14,106	2032/04/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.3140	599	597	15,052	2017/10/31		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,044	1,017	25,621	2020/03/31		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2600	533	528	13,307	2018/03/01		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	938	23,638	2023/03/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	477	424	10,700	2033/04/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	586	530	13,354	2028/06/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8890	656	645	16,258	2020/07/31		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	587	14,790	2043/09/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,028	25,898	2024/07/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	857	850	21,422	2021/09/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6540	648	640	16,115	2019/10/31		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	737	702	17,691	2025/09/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	700	687	17,315	2020/10/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,115	28,079	2022/09/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	620	573	14,429	2035/05/31		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7590	768	765	19,278	2019/03/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	702	682	17,174	2023/08/17		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	450	434	10,948	2046/03/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	50	47	1,202	2026/11/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	344	8,676	2021/11/30		
通貨小計	銘柄数	33銘柄							
	金額			27,216	26,495	667,167			
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	4,178	4,179	33,849	2018/12/21		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	5,768	5,614	45,480	2020/01/15		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	15,434	16,954	137,329	2026/12/21		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	7,612	5,398	43,731	2036/03/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	6,122	5,756	46,624	2021/03/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	8,904	6,265	50,752	2041/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	8,999	7,329	59,365	2031/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	4,639	4,429	35,877	2023/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	10,852	9,809	79,460	2048/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	7,321	6,550	53,055	2037/01/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	7,862	7,048	57,091	2030/01/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	6,044	5,475	44,351	2044/01/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	5,943	5,346	43,302	2032/03/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	3,166	2,957	23,954	2035/02/28		
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	1,579	1,472	11,930	2040/01/31			
通貨小計	銘柄数	15銘柄							
	金額			104,423	94,587	766,157			
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	2,309	2,624	70,841	2022/09/23		
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000	1,912	2,085	56,275	2019/10/25		
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000	2,078	2,016	54,428	2020/04/25		
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,377	3,073	82,956	2026/07/25		
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,127	2,056	55,512	2021/04/25		
	Poland Government Bond	国債証券	—	1,668	1,609	43,439	2018/10/25		
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	3,051	2,905	78,429	2021/07/25		
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	627	748	20,198	2029/04/25		
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	2,256	2,478	66,885	2020/10/25		
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	884	998	26,941	2021/10/25		
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,575	2,681	72,368	2023/10/25		
	Poland Government Bond	国債証券	3.7500	1,720	1,767	47,703	2018/04/25		
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,099	2,124	57,341	2018/07/25		
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,840	1,893	51,111	2019/07/25		
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,591	2,538	68,520	2025/07/25		
	通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額			31,114	31,602	852,954			
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国債証券	4.5000	759	831	99,506	2018/10/18		
	IRISH TREASURY	国債証券	4.4000	684	769	92,122	2019/06/18		
	IRISH TREASURY	国債証券	5.9000	570	674	80,755	2019/10/18		
	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,131	1,561	186,887	2025/03/13		
	IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	765	923	110,512	2020/10/18		
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	504	620	74,279	2023/03/20		
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	734	87,889	2024/03/18		
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	761	874	104,695	2030/05/15		

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	
					千ユーロ	千円	
	IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	539	64,526	2022/03/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	531	562	67,334	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	473	479	57,348	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	4.5000	1,035	1,205	144,243	2020/04/18
国 小 計	銘柄数 金 額	12銘柄		8,336	9,775	1,170,103	
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	810	97,025	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,239	1,918	229,702	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,355	2,168	259,569	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	986	118,036	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,544	1,663	199,097	2018/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,347	1,514	181,301	2019/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,146	1,318	157,806	2020/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,349	2,224	266,240	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,463	1,716	205,481	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,646	197,104	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,487	178,061	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,477	1,510	180,838	2018/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,558	186,595	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	924	962	115,270	2019/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,004	1,468	175,726	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,736	207,914	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,374	1,412	169,115	2020/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,323	1,336	159,954	2018/04/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,291	1,291	154,596	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	948	958	114,682	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	406	48,681	2022/01/15
国 小 計	銘柄数 金 額	21銘柄		25,028	30,098	3,602,804	
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,444	172,899	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	924	927	111,056	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	558	630	75,434	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,283	1,331	159,360	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	544	557	66,725	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	290	327	39,204	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	150	151	18,138	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,611	312,540	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,839	339,911	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	1,377	1,694	202,799	2022/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	966	1,026	122,885	2018/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	1,121	1,242	148,706	2019/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	1,736	2,018	241,660	2020/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,474	2,397	287,013	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,768	211,672	2021/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	801	1,099	131,659	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,659	198,647	2022/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	680	977	117,036	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	1,123	1,236	148,064	2019/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,543	184,699	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	1,052	1,083	129,742	2018/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	753	1,170	140,111	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,777	212,784	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	597	785	93,976	2034/06/22
国 小 計	銘柄数 金 額	24銘柄		25,843	32,303	3,866,730	
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	653	826	98,910	2019/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	685	1,056	126,519	2023/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,225	3,302	395,282	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,623	4,066	486,746	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,507	4,227	506,029	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,709	4,305	515,370	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,075	3,438	411,565	2019/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,564	2,612	312,730	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,230	3,809	456,050	2021/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,424	3,663	438,478	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,697	4,754	569,112	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,931	3,125	374,083	2018/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,567	2,809	336,319	2018/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,484	4,076	487,923	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,263	3,674	439,891	2019/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,380	3,837	459,403	2020/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,017	1,746	209,039	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,981	476,617	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,113	3,466	414,893	2020/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,550	4,158	497,726	2021/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,480	4,077	488,057	2022/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,099	3,735	447,199	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	3,063	366,724	2022/10/25

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	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,114	2,167	259,473	2018/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,088	2,917	349,277	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,712	444,401	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,920	1,983	237,463	2018/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,086	3,549	424,891	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,764	1,836	219,776	2019/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,787	3,332	398,856	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,799	3,110	372,293	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,322	2,394	286,576	2019/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,792	2,803	335,612	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,070	3,117	373,127	2020/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,335	1,346	161,223	2018/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,101	2,181	261,151	2025/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,193	2,244	268,718	2020/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,020	2,145	256,831	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,592	1,614	193,295	2019/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,737	2,700	323,196	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	879	871	104,333	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	257	255	30,571	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,170	2,194	262,660	2021/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,000	956	114,455	2026/11/25
国 小 計	銘柄数 金 額	44銘柄		104,489	125,253	14,992,864	
ユーロ (ドイツ)				千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	774	1,129	135,222	2024/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,067	1,764	211,170	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,157	258,272	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,426	170,712	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,663	199,076	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,443	292,507	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	3,009	360,213	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,071	3,364	402,736	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	2,120	253,870	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,798	1,894	226,743	2018/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,211	2,390	286,093	2018/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,399	2,605	311,896	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	2,682	2,938	351,793	2019/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,481	2,757	330,079	2019/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,075	2,331	279,106	2020/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,928	2,183	261,380	2020/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,374	2,146	256,990	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,444	1,603	191,955	2020/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,631	315,047	2021/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,968	235,598	2021/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,602	191,824	2021/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,707	1,921	229,954	2022/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,489	297,962	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,728	2,429	290,806	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,821	218,045	2022/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,568	187,757	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	2,025	242,474	2023/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,839	220,200	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,778	212,917	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,709	2,431	291,001	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,789	214,251	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,673	200,316	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,394	2,497	298,989	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,034	2,200	263,424	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,168	2,238	267,941	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,663	199,086	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	733	739	88,501	2017/12/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	747	754	90,354	2018/03/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,518	181,740	2018/06/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	709	84,957	2018/09/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,209	144,771	2018/02/23
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,392	1,412	169,023	2018/04/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,209	1,249	149,578	2018/10/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,438	1,495	178,962	2019/02/22
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,113	1,146	137,245	2019/04/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,151	1,183	141,679	2019/10/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,731	1,770	211,972	2020/04/17
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,448	1,496	179,177	2020/10/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,578	1,615	193,319	2021/04/09
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,227	146,873	2021/10/08
国 小 計	銘柄数 金 額	50銘柄		78,396	94,031	11,255,580	
ユーロ (スペイン)				千ユーロ	千ユーロ		
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,832	2,677	320,460	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,735	1,746	209,097	2017/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,745	1,779	212,989	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,552	1,556	186,368	2030/07/30

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	
					千ユーロ	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	260	261	31,277	2018/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,792	1,898	227,241	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1500	1,250	1,288	154,273	2020/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,802	215,802	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,172	1,175	140,721	2019/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,067	1,077	129,032	2021/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	852	879	105,299	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	400	430	51,527	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,230	1,204	144,178	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	2,965	355,000	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,654	2,148	257,145	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,428	2,036	243,820	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1000	2,206	2,357	282,135	2018/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	2,111	252,774	2024/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6000	2,382	2,659	318,348	2019/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3000	1,775	1,985	237,613	2019/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,173	1,630	195,129	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,101	2,365	283,127	2020/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	1,789	2,264	271,009	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,681	1,973	236,172	2020/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,515	3,066	367,061	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,265	1,761	210,907	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,499	299,173	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,000	2,108	252,387	2018/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,158	2,747	328,826	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,601	1,961	234,766	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,270	1,732	207,323	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,564	1,677	200,796	2018/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,049	1,558	186,502	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,836	1,951	233,588	2019/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,335	279,565	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,330	278,981	2024/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	1,968	235,587	2020/01/31
国 小 計	銘柄数	37銘柄					
	金 額			59,673	69,975	8,376,016	
ユーロ (イタリア)				千ユーロ	千ユーロ		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,658	198,464	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	510	755	90,433	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,431	410,709	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,925	230,496	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,376	1,388	166,245	2018/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0500	1,445	1,470	176,066	2019/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,129	1,188	142,320	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,229	1,246	149,192	2022/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,654	198,097	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,465	1,345	161,084	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,258	1,261	150,968	2018/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,511	1,519	181,890	2020/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,591	1,611	192,943	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,529	183,028	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3000	371	371	44,503	2018/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	774	775	92,781	2020/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,140	1,074	128,617	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,259	1,234	147,777	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,286	1,254	150,168	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	812	807	96,622	2019/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,674	1,648	197,380	2021/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	924	878	105,198	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,218	1,141	136,610	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	700	664	79,595	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	358	348	41,666	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	448	390	46,755	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	358	354	42,401	2019/10/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,654	3,559	426,023	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,127	494,080	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,455	2,089	250,133	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,074	2,250	269,409	2019/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,921	2,161	258,787	2020/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,098	2,829	338,657	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,390	2,878	344,515	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	3,098	370,873	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,480	2,610	312,482	2018/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,734	2,355	281,901	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,101	2,559	306,384	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,187	2,346	280,831	2018/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,708	2,961	354,516	2019/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,531	2,796	334,726	2019/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,654	317,706	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,893	2,561	306,665	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,560	2,869	343,433	2020/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,214	2,493	298,444	2020/09/01

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	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,527	302,580	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,415	289,106	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,692	322,321	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,418	289,540	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	2,059	246,567	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,910	2,376	284,457	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,295	1,338	160,241	2017/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,810	2,302	275,639	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,594	1,905	228,092	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,770	1,861	222,820	2018/06/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,363	1,805	216,175	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,638	315,836	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,111	2,248	269,111	2018/12/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,729	1,950	233,421	2021/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.5000	1,100	1,156	138,393	2019/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,901	2,191	262,266	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,938	2,219	265,627	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,688	202,077	2021/12/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	1.5000	1,246	1,282	153,495	2019/08/01
国 小 計	銘柄数	64銘柄					
	金 額			105,758	121,214	14,509,366	
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国債証券	0.3750	432	445	53,371	2020/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	411	49,285	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	292	35,065	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	411	414	49,639	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	199	23,929	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.3750	416	470	56,341	2019/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	882	105,596	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	3.3750	632	716	85,742	2020/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	3.5000	459	537	64,392	2021/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	484	58,009	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	612	677	81,098	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	491	58,786	2023/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	558	66,799	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	425	438	52,537	2018/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	603	72,291	2024/04/15
国 小 計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			6,718	7,626	912,887	
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国債証券	0.2500	527	539	64,592	2019/10/18
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	939	112,451	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	576	588	70,442	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	234	245	29,375	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	985	1,575	188,607	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.6500	1,066	1,131	135,386	2018/01/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.9000	1,248	1,446	173,136	2020/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,583	189,521	2021/09/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,073	1,692	202,604	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.3500	989	1,102	131,978	2019/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	675	953	114,130	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	963	115,327	2022/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	1,056	126,485	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	318	574	68,743	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	1.9500	738	787	94,228	2019/06/18
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	907	108,628	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,076	128,848	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	501	620	74,222	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.1500	426	440	52,781	2018/10/19
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,039	124,444	2024/10/21
国 小 計	銘柄数	20銘柄					
	金 額			15,749	19,264	2,305,937	
通貨小計	銘柄数	287銘柄					
	金 額			429,990	509,542	60,992,290	
合 計	銘柄数	742銘柄					
	金 額					152,458,096	

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

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

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

■損益の状況

当期 自2015年12月1日 至2016年11月30日

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年11月30日現在

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

- *期首における元本額は57,305,049,313円、当期中における追加設定元本額は5,269,599,218円、同解約元本額は3,568,516,951円です。
 *当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスV A 1,426,188,983円、ダイワ国内重視バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 47,463,120円、ダイワ国内重視バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 340,370,920円、ダイワ国際分散バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 85,931,327円、ダイワ国際分散バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 1,134,382,139円、ダイワファンドラップ外国債券インデックスエマージングプラス(為替ヘッジなし) 45,058,356円、ダイワファンドラップ外国債券インデックス(為替ヘッジなし) 79,097,081円、D-1's 外国債券インデックス850,783円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 17,978円、iFree 外国債券インデックス71,282,917円、iFree 8資産バランス23,335,905円、DCダイワ外国債券インデックス38,020,240,928円、ダイワ・ライフ・バランス30 588,263,235円、ダイワ・ライフ・バランス50 260,217,655円、ダイワ・ライフ・バランス70 159,536,254円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) 251,573,954円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) 202,071,895円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース) 59,946,308円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 12,384,412円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 15,705,795円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 932,613円、ダイワ世界バランスファンド40 V A 1,705,288,856円、ダイワ世界バランスファンド60 V A 194,065,438円、ダイワ・バランスファンド35 V A 7,200,012,883円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50 V A 519,885,779円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75 V A 335,883,404円、ダイワ・バランスファンド25 V A (適格機関投資家専用) 396,659,545円、ダイワ・インデックスセレクト外国債券103,331,290円、ダイワ・ノーロード外国債券ファンド7,209,795円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,614,367,146円、ダイワライフスタイル25 35,139,131円、ダイワライフスタイル50 55,152,766円、ダイワライフスタイル75 14,282,989円です。
 *当期末の計算口数当りの純資産額は26,265円です。

★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。	
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1期

（決算日 2017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1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00~17:00）

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

<2733>

設定以来の運用実績

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

(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。

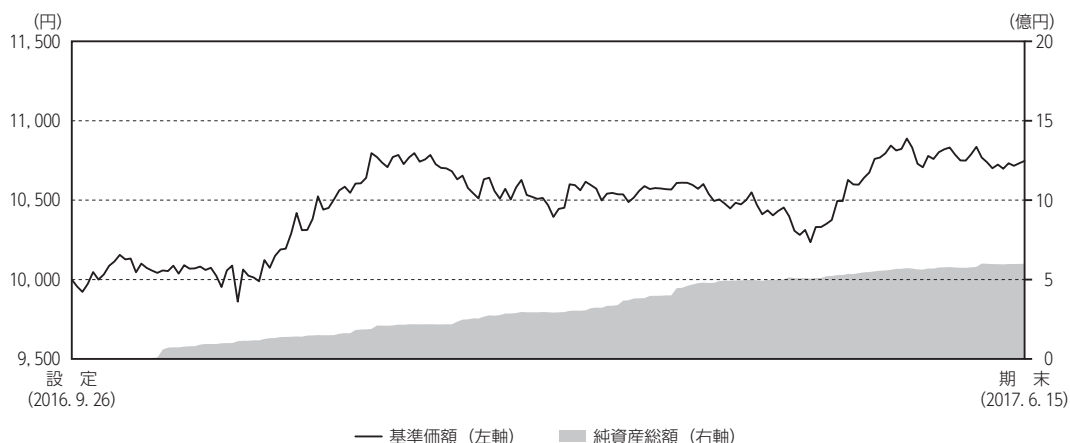
(注3) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

(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

設定時：10,000円

期末：10,747円

騰落率：7.5%

■ 組入ファンドの当期中の騰落率

組入ファンド	騰落率
外国債券インデックスマザーファンド	6.5%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	12.9%

■ 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、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		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率		
(設定) 2016年 9月26日	10,000	—	—	—
9月末	10,000	0.0	97.8	—
10月末	10,060	0.6	97.6	—
11月末	10,381	3.8	98.0	—
12月末	10,756	7.6	97.6	—
2017年 1月末	10,532	5.3	97.7	—
2月末	10,516	5.2	97.8	—
3月末	10,549	5.5	98.0	—
4月末	10,597	6.0	98.3	—
5月末	10,749	7.5	97.8	—
(期末) 2017年 6月15日	10,747	7.5	98.3	—

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2016. 9. 26 ~ 2017. 6. 15)

■ 外国債券市況

主要国の国債金利は、設定時より、E C B (欧州中央銀行) の資産買い入れの減額観測が出たことなどから上昇しました。また、2016年11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利し、今後の財政拡大などが意識されたことも、さらなる金利上昇の要因となりました。12月に米国で利上げが行われたことで米国の金利は上昇した一方、欧州では金融緩和が継続されたため金利は低下しました。その後、金利は上下に振れながらもおおむねレンジ内での推移となりました。2017年3月中旬以降は、トランプ政権の政策に対する不透明感などから金利はおおむね低下基調で推移しました。

新興国の債券市況は、おおむね先進国と同様の動きとなりましたが、個別国では、利下げサイクルにあったブラジルやコロンビア、ロシアなどの金利が低下しました。

■ 為替相場

為替相場は、設定時より、米国の利上げ観測などを受けて米ドル高が進行しました。その後、2016年11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことや12月の米国の利上げにより金利が上昇し、大きく円安が進みました。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月には欧州の政治リスクが後退したことから円安に転じましたが、5月はトランプ大統領のロシアとの不透明な関係をめぐる疑惑への懸念が高まったことなどから、再び円高傾向となりました。

ポートフォリオについて

(2016. 9. 26 ~ 2017. 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 (シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)) に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

■ 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・インデックスーエマージング・マーケッツ 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した。

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2016年9月26日 ～2017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)	746

- (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 (2016.9.26~2017.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	32円	0.303%	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10,473円です。
(投信会社)	(22)	(0.210)	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)	(8)	(0.078)	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)	(0.015)	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/期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権総口数 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	6	0.055	その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権総口数
(保管費用)	(5)	(0.049)	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)	(0.006)	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	38	0.358	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年9月26日から2017年6月15日まで)

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	89,550	114,266	592	794
外国債券インデックス・マザーファンド	178,891	469,302	375	1,001

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017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	120,209	20.0
外国債券インデックス・マザーファンド	478,422	79.8
コール・ローン等、その他	1,061	0.2
投資信託財産総額	599,694	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=109.72円、1カナダ・ドル=82.89円、1オーストラリア・ドル=83.28円、1シンガポール・ドル=79.70円、1イギリス・ポンド=139.91円、1スイス・フラン=112.97円、1トルコ・リラ=31.46円、1デンマーク・クローネ=16.56円、1ノルウェー・クローネ=13.03円、1スウェーデン・クローネ=12.61円、1メキシコ・ペソ=6.12円、1フィリピン・ペソ=2.22円、1アルゼンチン・ペソ=6.91円、100チリ・ペソ=16.62円、100コロンビア・ペソ=3.74円、100インドネシア・ルピア=0.83円、1ブラジル・リアル=33.49円、1チェコ・コルナ=4.70円、1ルーマニア・レイ=26.88円、1ロシア・ルーブル=1.92円、1マレーシア・リングギット=25.80円、1南アフリカ・ランド=8.70円、1タイ・バーツ=3.24円、1ペルー・ソル=33.55円、1ポーランド・ズロチ=29.33円、100ハンガリー・フォリント=40.23円、1ユーロ=123.11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(5,271,067千円)の投資信託財産総額(5,358,165千円)に対する比率は、98.4%です。
外国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(159,262,330千円)の投資信託財産総額(159,534,083千円)に対する比率は、99.8%です。

■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。

■投信会社(自社)による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
1	—	1	—	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	当期末	
	口数	評価額
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	88,958	120,209
外国債券インデックス・マザーファンド	178,516	478,422

(注) 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6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	599,694,538円
コール・ローン等	1,061,917
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド (評価額)	120,209,637
外国債券インデックスマザーファンド (評価額)	478,422,984
(B) 負債	513,129
未払信託報酬	503,277
その他未払費用	9,852
(C) 純資産総額 (A - B)	599,181,409
元本	557,544,250
次期繰越損益金	41,637,159
(D) 受益権総口数	557,544,250口
1万口当り基準価額 (C/D)	10,747円

*設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は571,935,222円、同解約元本額は15,390,972円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,747円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月26日 至2017年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 196円
受取利息	3
支払利息	△ 199
(B) 有価証券売買損益	16,562,855
売買益	16,870,170
売買損	△ 307,315
(C) 信託報酬等	△ 970,654
(D) 当期損益金 (A + B + C)	15,592,005
(E) 追加信託差損益金	26,045,154
(配当等相当額)	(△ 88)
(売買損益相当額)	(26,045,242)
(F) 合計 (D + E)	41,637,159
次期繰越損益金 (F)	41,637,159
追加信託差損益金	26,045,154
(配当等相当額)	(△ 88)
(売買損益相当額)	(26,045,242)
分配準備積立金	15,592,201
繰越損益金	△ 196

(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	15,592,201
(c) 収益調整金	26,045,242
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	41,637,443
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	41,637,443
(h) 受益権総口数	557,544,250口

「外国債券インデックスマザーファンド」の第17期にかかる運用状況については192～205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「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2016年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017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。180～191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（2016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（2017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

(2016年9月26日から2017年6月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
Chile Government International Bond (チリ) 5.5% 2020/8/5	86,670	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/1/1	39,157
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/7/1	68,489	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/7/1	38,712
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/4/1	49,173	Mexican Bonos (メキシコ) 4.75% 2018/6/14	27,777
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.5% 2037/1/31	38,159	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/4/1	25,768
Thailand Government Bond (タイ) 1.875% 2022/6/17	34,468	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/1/1	25,047
Mexican Bonos (メキシコ) 5% 2019/12/11	33,978	Poland Government Bond (ポーランド) 3.75% 2018/4/25	21,956
REPUBLIC OF ARGENTINA (アルゼンチン) 15.5% 2026/10/17	32,679	Poland Government Bond (ポーランド) 5.25% 2017/10/25	21,500
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/1/1	31,854	Mexican Bonos (メキシコ) 7.75% 2017/12/14	18,652
Mexican Bonos (メキシコ) 10% 2024/12/5	29,183	Turkey Government Bond (トルコ) 6.3% 2018/2/14	17,903
Poland Government Bond (ポーランド) 2.25% 2022/4/25	28,650	MALAYSIAN GOVERNMENT (マレーシア) 4.24% 2018/2/7	17,160

(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、2017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（3,958,047千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	2017年6月15日現在						
		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
	千トルコ・リラ	千トルコ・リラ	千円	%	%	%	%	%
トルコ	13,630	13,061	410,919	7.7	—	3.5	3.3	1.0
	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ						
メキシコ	83,990	87,543	535,768	10.0	—	5.6	3.6	0.8
	千フィリピン・ペソ	千フィリピン・ペソ						
フィリピン	5,000	5,182	11,505	0.2	—	—	0.2	—
	千アルゼンチン・ペソ	千アルゼンチン・ペソ						
アルゼンチン	8,500	9,406	64,996	1.2	1.2	0.8	0.4	—
	千チリ・ペソ	千チリ・ペソ						
チリ	490,000	520,870	86,568	1.6	—	—	1.6	—
	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ						
コロンビア	9,395,000	10,325,866	386,187	7.2	—	4.3	2.5	0.4
	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア						
インドネシア	56,749,000	61,000,806	506,306	9.5	—	7.4	1.7	0.4
	千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル						
ブラジル	17,460	15,383	515,191	9.6	—	2.8	4.0	2.8
	千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ						
チェコ	19,900	23,729	111,526	2.1	—	1.5	0.6	—
	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ						
ルーマニア	4,940	5,371	144,373	2.7	—	1.0	1.3	0.4
	千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル						
ロシア	173,540	173,885	333,860	6.2	—	3.9	1.7	0.6
	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット						
マレーシア	13,900	13,964	360,275	6.7	—	3.6	2.7	0.4
	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド						
南アフリカ	56,860	53,198	462,830	8.7	—	7.6	0.8	0.2
	千タイ・バーツ	千タイ・バーツ						
タイ	108,360	115,870	375,420	7.0	—	3.9	1.9	1.3
	千ペルー・ソル	千ペルー・ソル						
ペルー	3,230	3,550	119,121	2.2	—	2.0	0.2	—
	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ						
ポーランド	16,640	16,877	495,022	9.3	—	3.2	4.4	1.6
	千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント						
ハンガリー	490,400	557,354	224,223	4.2	—	2.1	1.9	0.2
合 計	—	—	5,144,099	96.2	1.2	53.3	32.8	10.1

(注1) 邦貨換算金額は、2017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)

2017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 681	千円 21,424	2020/01/15	
	Turkey Government Bond	国債証券	9.5000	510	492	15,483	2022/01/12	
	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	790	729	22,964	2022/09/14	
	Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	780	672	21,152	2023/03/08	
	Turkey Government Bond	国債証券	8.8000	790	735	23,126	2023/09/27	
	Turkey Government Bond	国債証券	8.8000	630	615	19,349	2018/11/14	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	470	468	14,739	2019/03/27	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	682	21,478	2024/03/20	
	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	710	683	21,498	2019/07/10	
	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	630	590	18,581	2024/07/24	
	Turkey Government Bond	国債証券	7.4000	570	529	16,659	2020/02/05	
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	1,490	1,310	41,226	2025/03/12	
	Turkey Government Bond	国債証券	9.4000	1,180	1,146	36,083	2020/07/08	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	910	917	28,857	2021/02/17	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	1,170	1,190	37,452	2026/02/11	
	Turkey Government Bond	国債証券	8.7000	550	539	16,980	2018/07/11	
	Turkey Government Bond	国債証券	9.2000	570	546	17,183	2021/09/22	
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	520	530	16,678	2022/03/02	
	通貨小計	銘柄数	18銘柄					
		金 額			13,630	13,061	410,919	
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 9,368	57,334	2019/12/11	
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	4,900	4,518	27,654	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	1,300	1,425	8,725	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	4,250	4,480	27,423	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,750	9,117	55,799	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	4,030	4,179	25,578	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,390	3,103	18,992	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	2,430	2,718	16,639	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,900	7,045	43,121	2018/12/13	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	3,300	3,773	23,092	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	6,590	6,776	41,470	2020/06/11	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	9,950	9,793	59,937	2021/06/10	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	4,950	5,249	32,126	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	5,450	5,345	32,714	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,820	8,329	50,973	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	2,180	2,317	14,183	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金 額			83,990	87,543	535,768		
フィリピン	Philippine Government International Bond	国債証券	4.9500	千フィリピン・ペソ 5,000	千フィリピン・ペソ 5,182	11,505	2021/01/15	
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金 額			5,000	5,182	11,505		
アルゼンチン	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	18.2000	千アルゼンチン・ペソ 3,100	千アルゼンチン・ペソ 3,393	23,446	2021/10/03	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	16.0000	1,400	1,529	10,568	2023/10/17	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	15.5000	4,000	4,483	30,981	2026/10/17	
通貨小計	銘柄数	3銘柄						
	金 額			8,500	9,406	64,996		
チリ	Chile Government International Bond	国債証券	5.5000	千チリ・ペソ 490,000	千チリ・ペソ 520,870	86,568	2020/08/05	
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金 額			490,000	520,870	86,568		
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 117,036	4,377	2027/06/28	
	Colombia Government International Bond	国債証券	7.7500	95,000	102,619	3,837	2021/04/14	
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	42,251	1,580	2023/03/21	
	Colombian TES	国債証券	5.0000	520,000	521,882	19,518	2018/11/21	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	735,000	762,121	28,503	2019/09/11	
	Colombian TES	国債証券	11.0000	1,095,000	1,270,977	47,534	2020/07/24	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	1,375,000	1,455,382	54,431	2022/05/04	
	Colombian TES	国債証券	10.0000	1,650,000	2,032,684	76,022	2024/07/24	
	Colombian TES	国債証券	6.0000	940,000	911,292	34,082	2028/04/28	
	Colombian TES	国債証券	7.5000	1,530,000	1,670,622	62,481	2026/08/26	
	Colombian TES	国債証券	7.7500	940,000	1,049,481	39,250	2030/09/18	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	380,000	389,515	14,567	2032/06/30	
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金 額			9,395,000	10,325,866	386,187		
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	千インドネシア・ルピア 3,850,000	千インドネシア・ルピア 4,121,117	34,205	2036/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	4,000,000	4,487,840	37,249	2031/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	2,400,000	2,717,712	22,557	2020/11/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	12.8000	600,000	728,370	6,045	2021/06/15	

2017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	
			%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	1,000,000	1,244,920	10,332	2025/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	980,000	1,233,869	10,241	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,410,000	4,659,385	38,672	2021/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	1,270,000	1,496,212	12,418	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	4,924,000	5,424,918	45,026	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	3,350,000	3,578,972	29,705	2032/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	4,230,000	4,270,734	35,447	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	2,560,000	2,598,169	21,564	2022/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	1,410,000	1,331,152	11,048	2023/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	1,200,000	1,103,376	9,158	2028/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	1,975,000	1,813,484	15,051	2033/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	4,720,000	5,076,548	42,135	2034/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	6,350,000	6,863,080	56,963	2024/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	4,920,000	5,583,265	46,341	2029/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.8750	2,600,000	2,667,678	22,141	2019/04/15
通貨小計	銘柄数	19銘柄					
	金 額			56,749,000	61,000,806	506,306	
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	千ブラジル・レアル 1,660	千ブラジル・レアル 1,655	55,458	2021/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	2,030	1,998	66,915	2023/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	280	283	9,493	2019/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	1,390	1,351	45,270	2025/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	1,180	1,140	38,179	2027/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	2,070	1,809	60,589	2019/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,510	1,257	42,119	2019/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,580	1,248	41,811	2020/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,000	894	29,945	2018/10/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	3,040	2,277	76,258	2020/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,720	1,467	49,149	2019/04/01
通貨小計	銘柄数	11銘柄					
	金 額			17,460	15,383	515,191	
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.7500	千チェコ・コルナ 3,500	千チェコ・コルナ 3,949	18,562	2020/09/12
	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.8500	1,300	1,524	7,163	2021/09/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	3,100	3,635	17,086	2028/08/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	3,400	4,718	22,174	2024/05/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.5000	1,200	1,251	5,879	2019/10/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	3,000	3,761	17,679	2022/09/12
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	3,100	3,571	16,785	2025/09/17
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	700	721	3,393	2026/06/26
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	600	596	2,802	2030/05/15
通貨小計	銘柄数	9銘柄					
	金 額			19,900	23,729	111,526	
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	5.8500	千ルーマニア・レイ 430	千ルーマニア・レイ 499	13,424	2023/04/26
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	360	384	10,345	2019/06/24
	Romania Government Bond	国債証券	5.6000	420	448	12,048	2018/11/28
	Romania Government Bond	国債証券	5.9500	440	501	13,482	2021/06/11
	Romania Government Bond	国債証券	5.7500	770	858	23,084	2020/04/29
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	580	635	17,079	2025/02/24
	Romania Government Bond	国債証券	2.5000	360	368	9,912	2019/04/29
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	430	446	12,008	2021/03/22
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	300	352	9,473	2027/07/26
	Romania Government Bond	国債証券	2.2500	370	376	10,123	2020/02/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.5000	480	498	13,389	2022/12/19
通貨小計	銘柄数	11銘柄					
	金 額			4,940	5,371	144,373	
ロシア	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	千ロシア・ルーブル 7,880	千ロシア・ルーブル 7,860	15,091	2021/04/14
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	7,130	7,116	13,663	2019/02/27
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	18,760	19,694	37,812	2027/02/03
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	11,910	11,927	22,900	2022/07/20
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.8000	6,500	6,372	12,235	2019/12/11
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	8,400	8,194	15,732	2023/01/25
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	11,660	11,212	21,528	2028/01/19
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.4000	14,100	13,710	26,324	2020/05/27
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.7000	10,700	10,560	20,275	2019/05/15
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,300	13,913	26,714	2023/08/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	18,300	18,245	35,030	2021/08/18
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	16,300	17,481	33,564	2031/09/17
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	11,600	11,728	22,518	2026/09/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	5,000	4,980	9,561	2022/12/07
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	11,000	10,887	20,903	2033/03/23
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			173,540	173,885	333,860	

2017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		
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3900	600	615	15,868	2023/07/07	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0700	500	498	12,857	2026/09/30	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7430	280	279	7,217	2021/08/26	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	970	991	25,584	2019/11/29	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	620	629	16,251	2030/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	920	937	24,199	2021/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	670	660	17,046	2031/06/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5800	510	512	13,217	2018/09/28	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	440	434	11,212	2022/08/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	540	539	13,930	2020/03/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	860	845	21,809	2023/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	740	755	19,497	2024/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	650	660	17,045	2021/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6540	910	914	23,602	2019/10/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	660	659	17,023	2025/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	590	592	15,274	2020/10/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	590	592	15,297	2022/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	570	557	14,393	2035/05/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7590	380	382	9,878	2019/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	500	498	12,867	2023/08/17	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	800	802	20,711	2026/11/30		
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	600	600	15,487	2021/11/30		
通貨小計	銘柄数	22銘柄						
	金額			13,900	13,964	360,275		
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	1,120	1,130	9,835	2018/12/21	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	2,590	2,584	22,487	2020/01/15	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	8,450	9,605	83,569	2026/12/21	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	3,220	2,351	20,460	2036/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	2,560	2,497	21,725	2021/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	4,280	3,087	26,858	2041/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	4,240	3,581	31,162	2031/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	2,980	2,964	25,787	2023/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	4,970	4,573	39,790	2048/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	8,350	7,645	66,516	2037/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	4,000	3,729	32,444	2030/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	3,200	2,945	25,625	2044/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	3,800	3,540	30,798	2032/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	2,100	2,008	17,470	2035/02/28	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	1,000	953	8,298	2040/01/31		
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額			56,860	53,198	462,830		
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	3.8750	17,200	17,997	58,311	2019/06/13	
	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	12,950	15,741	51,002	2029/06/22	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	11,500	12,437	40,296	2023/06/16	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	11,310	12,578	40,755	2025/12/12	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	17,600	18,953	61,408	2021/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4500	2,800	2,892	9,373	2019/03/08	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.5500	12,000	12,326	39,937	2020/06/26	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.8750	10,500	10,450	33,858	2022/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	5,100	5,307	17,194	2036/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	7,400	7,185	23,281	2026/12/17	
通貨小計	銘柄数	10銘柄						
	金額			108,360	115,870	375,420		
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	580	599	20,120	2024/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	570	602	20,211	2028/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	535	642	21,539	2026/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	7.8400	310	344	11,547	2020/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	465	511	17,164	2037/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	770	850	28,538	2031/08/12	
通貨小計	銘柄数	6銘柄						
	金額			3,230	3,550	119,121		
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	910	1,051	30,837	2022/09/23	
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000	880	951	27,899	2019/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000	1,210	1,191	34,953	2020/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,740	1,670	49,005	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	1,560	1,540	45,192	2021/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	—	1,270	1,242	36,431	2018/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	1,130	1,103	32,354	2021/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	910	863	25,315	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	1,050	1,037	30,433	2022/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	—	830	802	23,541	2019/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	620	680	19,963	2020/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	570	648	19,010	2021/10/25	
	通貨小計	銘柄数	14銘柄					
		金額			108,360	115,870	375,420	

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2017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	4.0000	千ポーランド・ズロチ 1,030	千ポーランド・ズロチ 1,106	千円 32,443	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	940	950	27,865	2018/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	810	832	24,427	2019/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,180	1,205	35,348	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	16銘柄					
	金 額			16,640	16,877	495,022	
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 72,040	28,982	2020/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	55,500	57,950	23,313	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	23,000	23,080	9,285	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	23,000	23,908	9,618	2019/10/30
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	39,000	40,889	16,449	2021/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	7.5000	44,500	54,363	21,870	2020/11/12
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	48,800	60,349	24,278	2023/11/24
	Hungary Government Bond	国債証券	6.5000	58,800	66,281	26,665	2019/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	45,000	56,949	22,910	2022/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	24,000	25,962	10,444	2018/12/20
Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	62,500	75,578	30,405	2025/06/24	
通貨小計	銘柄数	11銘柄					
	金 額			490,400	557,354	224,223	
合 計	銘柄数	196銘柄					
	金 額					5,144,099	

(注1) 邦貨換算金額は、2017年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売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6期 (決算日 2016年7月5日)

(計算期間 2015年7月7日～2016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6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

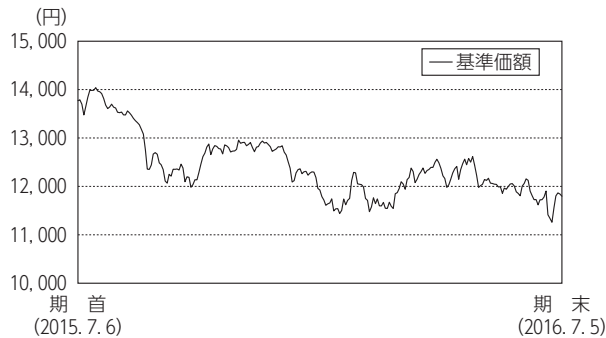
大和投資信託

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：13,771円 期末：11,798円 騰落率：△14.3%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券の利息収入はプラスに寄りましたが、新興国通貨の対円為替レートの下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○新興国債券市況

米国の金融政策の正常化への思惑から新興国の多くで金利が上昇する局面もありましたが、原油をはじめとする商品価格の反発などを背景に投資家心理が改善を見せたことや、米国の利上げペースが緩やかなものにとどまるとの市場の観測から、金利が低下する国が多くなりました。個別の国では、インフレ懸念の後退や景気の悪化により将来の利下げ期待が高まったブラジルで金利が低下しました。

○為替相場

中国経済の減速懸念などで市場のリスク回避姿勢が高まったことから、新興国通貨は対円で下落しました。その後、原油価格の反発などから投資家心理は改善しましたが、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利したことを受け円高が進行したことなどから、対円で下落する通貨が多くなりました。個別の通貨では、政治的不透明感の高まりや中央銀行の金融政策への不信感が嫌気されてトルコ・リラが下落したほか、米国の利上げの影響が懸念されたメキシコ・ペソが下落しました。

◆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

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は△14.4%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△14.3%となり、ベンチマークの騰落率を上回りました。これは、ベンチマークとファンドが投資しているユニバースの差異によるもの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	公社債組入比率
	円	%	%	%		
(期首) 2015年7月6日	13,771	—	—	—	14,494	96.9
7月末	13,637	△ 1.0	—	△ 1.6	14,257	96.4
8月末	12,698	△ 7.8	—	△ 8.2	13,309	97.2
9月末	12,036	△ 12.6	—	△ 13.1	12,589	92.0
10月末	12,732	△ 7.5	—	△ 8.1	13,322	95.3
11月末	12,723	△ 7.6	—	△ 7.4	13,414	96.5
12月末	12,296	△ 10.7	—	△ 10.9	12,909	97.3
2016年1月末	12,119	△ 12.0	—	△ 12.3	12,711	96.7
2月末	11,589	△ 15.8	—	△ 15.7	12,218	97.5
3月末	12,497	△ 9.3	—	△ 9.1	13,177	95.7
4月末	12,443	△ 9.6	—	△ 10.0	13,040	95.6
5月末	12,059	△ 12.4	—	△ 12.6	12,667	96.2
6月末	11,803	△ 14.3	—	△ 14.5	12,388	96.8
(期末) 2016年7月5日	11,798	△ 14.3	—	△ 14.4	12,413	97.3

(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	34
（保管費用）	(33)
（その他）	(1)
合 計	34

(注1) 期中の費用（消費税が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方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

(2015年7月7日から2016年7月5日まで)

		買付額	売付額
外	トルコ	千トルコ・リラ 3,961	千トルコ・リラ 1,301 (—)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 28,162	千メキシコ・ペソ 6,932 (—)
	コロンビア	千コロンビア・ペソ 2,464,607	千コロンビア・ペソ 56,804 (—)
	インドネシア	千インドネシア・ルピア 16,024,712	千インドネシア・ルピア 5,169,064 (—)
	ブラジル	千ブラジル・レアル 8,023	千ブラジル・レアル 6,535 (—)
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 2,084	千ルーマニア・レイ 1,121 (—)
	ロシア	千ロシア・ルーブル 59,465	千ロシア・ルーブル 26,841 (—)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 5,251	千マレーシア・リンギット 2,055 (—)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 20,363	千南アフリカ・ランド 5,301 (—)
	タイ	千タイ・バーツ 42,429	千タイ・バーツ 18,918 (—)
	ペルー	千ペルー・ヌエボソル 621	千ペルー・ヌエボソル 74 (—)
	ナイジェリア	千ナイジェリア・ナイラ —	千ナイジェリア・ナイラ 87,763 (—)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 7,294	千ポーランド・ズロチ 3,810 (—)
	ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 214,149	千ハンガリー・フォリント 50,101 (—)

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2015年7月7日から2016年7月5日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.375% 2026/9/15	32,279	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2017/1/1	42,942
Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2026/7/25	31,464	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2017/7/1	38,870
Thailand Government Bond (タイ) 2.55% 2020/6/26	30,143	Thailand Government Bond (タイ) 3.25% 2017/6/16	34,745
Turkey Government Bond (トルコ) 8% 2025/3/12	29,544	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2017/1/1	24,646
Turkey Government Bond (トルコ) 9.4% 2020/7/8	29,075	Poland Government Bond (ポーランド) 4.75% 2016/10/25	23,068
Poland Government Bond (ポーランド) 2% 2021/4/25	26,305	Mexican Bonos (メキシコ) 7.25% 2016/12/15	22,817
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 10.5% 2026/12/21	26,265	Turkey Government Bond (トルコ) 9% 2017/3/8	20,406
Mexican Bonos (メキシコ) 8.5% 2018/12/13	24,741	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2025/1/1	19,640
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2021/1/1	24,199	Poland Government Bond (ポーランド) 5.5% 2019/10/25	19,623
Thailand Government Bond (タイ) 4.875% 2029/6/22	22,893	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2021/1/1	19,611

(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			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		千円			%	5年以上	2年以上	2年未満
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額							
トルコ	千トルコ・リラ 9,460	千トルコ・リラ 9,510	335,252	9.7	—	4.3	4.3	1.1		
メキシコ	千メキシコ・ペソ 54,670	千メキシコ・ペソ 60,970	338,384	9.8	—	5.5	3.2	1.2		
フィリピン	千フィリピン・ペソ 5,000	千フィリピン・ペソ 5,244	11,432	0.3	—	—	0.3	—		
コロンビア	千コロンビア・ペソ 6,465,000	千コロンビア・ペソ 6,786,524	236,849	6.9	—	4.4	2.4	—		
インドネシア	千インドネシア・ルピア 40,719,000	千インドネシア・ルピア 42,979,199	339,535	9.8	—	8.7	1.0	0.2		
ブラジル	千ブラジル・レアル 12,770	千ブラジル・レアル 10,589	331,559	9.6	9.6	2.3	4.0	3.3		
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 3,190	千ルーマニア・レイ 3,529	89,075	2.6	—	0.7	1.6	0.3		
ロシア	千ロシア・ルーブル 120,540	千ロシア・ルーブル 115,912	185,460	5.4	—	2.8	1.8	0.8		
マレーシア	千マレーシア・リンギット 12,570	千マレーシア・リンギット 12,816	327,728	9.5	—	4.7	3.2	1.7		
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 48,640	千南アフリカ・ランド 45,068	316,381	9.2	—	7.2	1.6	0.4		
タイ	千タイ・バーツ 82,800	千タイ・バーツ 92,679	270,623	7.8	—	4.8	2.4	0.7		
ペルー	千ペルー・ヌエボソル 1,960	千ペルー・ヌエボソル 2,123	66,094	1.9	—	1.6	0.3	—		
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 12,290	千ポーランド・ズロチ 12,859	330,489	9.6	—	4.2	4.3	1.1		
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 435,000	千ハンガリー・フォリント 491,818	177,005	5.1	5.1	2.1	2.1	0.9		
合計	—	—	3,355,871	97.3	14.7	53.2	32.4	11.7		

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国(外貨建) 公社債(銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千トルコ・リラ	千円	
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	480	507	17,901	2020/01/15
	Turkey Government Bond	国債証券	9.5000	510	527	18,597	2022/01/12
	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	490	483	17,039	2022/09/14
	Turkey Government Bond	国債証券	6.3000	600	582	20,536	2018/02/14
	Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	780	714	25,199	2023/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	8.3000	530	528	18,626	2018/06/20
	Turkey Government Bond	国債証券	8.8000	540	537	18,939	2023/09/27
	Turkey Government Bond	国債証券	8.8000	630	634	22,362	2018/11/14
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	370	387	13,642	2019/03/27
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	330	358	12,650	2024/03/20
	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	710	710	25,052	2019/07/10
	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	630	633	22,340	2024/07/24
	Turkey Government Bond	国債証券	7.4000	570	549	19,359	2020/02/05
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	640	605	21,353	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	9.4000	740	758	26,737	2020/07/08
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	570	612	21,589	2021/02/17
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	340	377	13,324	2026/02/11
通貨小計	銘柄数 金 額	17銘柄		9,460	9,510	335,252	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.0000	3,900	3,847	21,355	2019/12/11
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	1,400	1,375	7,634	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	1,950	2,209	12,260	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	5,550	7,069	39,234	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	2,030	2,269	12,593	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	3,280	3,435	19,068	2017/12/14
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	1,490	2,104	11,679	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	2,430	2,931	16,272	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	5,750	6,164	34,213	2018/12/13
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	2,300	2,878	15,976	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	3,190	3,478	19,305	2020/06/11
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	5,950	6,213	34,483	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	3,450	3,947	21,907	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	2,250	2,354	13,069	2022/06/09

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	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						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	7.7500	3,620	4,241	23,540	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	4.7500	3,950	3,944	21,891	2018/06/14
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	2,180	2,504	13,897	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	17銘柄			54,670	60,970	338,384	
				%	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	5,000	5,244	11,432	2021/01/15
通貨小計	銘柄数 金 額	1銘柄			5,000	5,244	11,432	
				%	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ	千円	
		Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	90,000	108,158	3,774	2027/06/28
		Colombia Government International Bond	国債証券	7.7500	95,000	97,907	3,416	2021/04/14
		Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	38,628	1,348	2023/03/21
		Colombian TES	国債証券	5.0000	520,000	504,166	17,595	2018/11/21
		Colombian TES	国債証券	7.0000	615,000	622,564	21,727	2019/09/11
		Colombian TES	国債証券	11.0000	1,025,000	1,180,041	41,183	2020/07/24
		Colombian TES	国債証券	7.0000	735,000	737,410	25,735	2022/05/04
		Colombian TES	国債証券	10.0000	1,300,000	1,517,867	52,973	2024/07/24
		Colombian TES	国債証券	6.0000	630,000	557,424	19,454	2028/04/28
		Colombian TES	国債証券	7.5000	800,000	801,912	27,986	2026/08/26
		Colombian TES	国債証券	7.7500	610,000	620,443	21,653	2030/09/18
通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄			6,465,000	6,786,524	236,849	
				%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	1,500,000	1,604,340	12,674	2036/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	1,600,000	1,774,752	14,020	2031/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	700,000	797,027	6,296	2020/11/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	12.8000	600,000	734,130	5,799	2021/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	1,000,000	1,231,880	9,731	2025/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	980,000	1,225,882	9,684	2030/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	3,060,000	3,202,412	25,299	2021/07/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	1,120,000	1,299,144	10,263	2031/07/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	4,424,000	4,754,384	37,559	2026/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	1,970,000	2,066,116	16,322	2032/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	990,000	954,894	7,543	2027/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	1,460,000	1,434,201	11,330	2022/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	1,410,000	1,277,883	10,095	2023/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	1,200,000	1,063,992	8,405	2028/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	1,975,000	1,770,903	13,990	2033/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.2500	870,000	843,969	6,667	2018/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	4,030,000	4,337,247	34,264	2034/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	5,510,000	5,815,419	45,941	2024/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	3,720,000	4,134,928	32,665	2029/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.8750	2,600,000	2,655,692	20,979	2019/04/15
通貨小計	銘柄数 金 額	20銘柄			40,719,000	42,979,199	339,535	
				%	千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル	千円	
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	1,430	1,337	41,885	2021/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	350	338	10,603	2018/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	1,380	1,260	39,456	2023/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	280	268	8,406	2019/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	920	828	25,954	2025/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,220	1,021	31,992	2018/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,270	1,007	31,535	2018/07/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	560	496	15,543	2027/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,870	1,404	43,986	2019/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,020	725	22,713	2019/07/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	680	584	18,309	2017/10/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	790	643	20,163	2018/04/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,000	671	21,010	2020/01/01
通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄			12,770	10,589	331,559	
				%	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ	千円	
		Romania Government Bond	国債証券	5.8500	430	507	12,814	2023/04/26
		Romania Government Bond	国債証券	4.7500	360	391	9,871	2019/06/24
		Romania Government Bond	国債証券	5.6000	420	463	11,697	2018/11/28
		Romania Government Bond	国債証券	5.9500	440	509	12,871	2021/06/11
		Romania Government Bond	国債証券	5.7500	360	408	10,311	2020/04/29
		Romania Government Bond	国債証券	4.7500	380	421	10,633	2025/02/24
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	380	394	9,962	2018/01/17

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			
	銘柄数	Romania Government Bond	国債証券	%	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ	千円	2019/04/29		
		金 額	Romania Government Bond	国債証券	2.5000	220	225	5,686	2021/03/22	
		9銘柄			200	207	5,225			
通貨小計	銘柄数	9銘柄			3,190	3,529	89,075			
	金 額									
ロシア	銘柄数	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	%	千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル	千円	2018/03/15		
		金 額	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	6,800	6,653	10,646	2021/04/14	
			Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	7,880	7,640	12,225	2019/02/27	
			Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	7,130	6,912	11,060	2027/02/03	
			Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	13,060	13,141	21,026	2022/07/20	
			Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	6,610	6,391	10,226	2019/12/11	
			Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.8000	6,500	6,162	9,859	2023/01/25	
			Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	8,400	7,909	12,655	2028/01/19	
			Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	11,660	10,789	17,262	2018/01/31	
			Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.2000	6,600	6,313	10,102	2020/05/27	
			Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.4000	8,100	7,563	12,101	2019/05/15	
			Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.7000	10,000	9,506	15,209	2023/08/16	
			Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	11,800	11,062	17,700	2021/08/18	
			Russian Foreign Bond - Eurobond	国債証券	7.8500	5,000	4,894	7,831	2031/09/17	
		通貨小計	銘柄数	15銘柄			120,540	115,912	185,460	
	金 額									
マレーシア	銘柄数	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	2018/02/07		
		金 額	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2400	660	676	17,304	2019/07/30	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7340	350	375	9,598	2019/11/29	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	780	809	20,693	2017/09/15	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0120	540	548	14,025	2030/04/15	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	620	646	16,542	2021/07/15	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	560	579	14,819	2026/04/15	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	490	514	13,167	2031/06/30	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	330	336	8,598	2018/09/28	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5800	510	518	13,245	2022/08/15	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	440	434	11,109	2032/04/15	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1270	280	276	7,067	2017/10/31	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.3140	560	564	14,446	2020/03/31	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	540	543	13,906	2018/03/01	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2600	460	464	11,879	2023/03/15	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	470	464	11,877	2033/04/15	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	220	209	5,361	2020/07/31	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8890	470	481	12,309	2024/07/15	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	510	526	13,460	2021/09/30	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	650	672	17,185	2019/10/31	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6540	560	567	14,505	2025/09/15	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	660	668	17,095	2020/10/15	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	590	599	15,320	2022/09/30	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	590	595	15,220	2019/03/15	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7590	380	387	9,901	2023/08/17	
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	350	355	9,085		
		通貨小計	銘柄数	25銘柄			12,570	12,816	327,728	
	金 額									
南アフリカ	銘柄数	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	2017/09/15		
		金 額	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	1,930	1,946	13,663	2018/12/21	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	2,350	2,357	16,550	2020/01/15	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	2,940	2,872	20,162	2026/12/21	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	6,300	7,078	49,687	2036/03/31	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	3,920	2,871	20,158	2021/03/31	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	2,760	2,606	18,294	2041/02/28	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	3,750	2,707	19,006	2031/02/28	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	4,240	3,525	24,749	2023/02/28	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	2,280	2,203	15,467	2048/02/28	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	4,970	4,625	32,472	2037/01/31	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	3,000	2,771	19,453	2030/01/31	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	3,400	3,121	21,912	2044/01/31	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	2,600	2,426	17,036	2032/03/31	
			REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	2,500	2,305	16,181	2035/02/28	
		通貨小計	銘柄数	15銘柄			48,640	45,068	316,381	
			金 額							

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	
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	5.1250	千タイ・バーツ 4,250	千タイ・バーツ 4,504	千円 13,153	2018/03/13
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8750	15,000	16,002	46,727	2019/06/13
	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	11,050	14,425	42,122	2029/06/22
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	9,600	10,751	31,393	2023/06/16
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8000	3,300	3,352	9,788	2017/10/10
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	8,950	10,462	30,551	2025/12/12
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	15,400	16,971	49,556	2021/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4500	2,900	3,042	8,885	2019/03/08
	Thailand Government Bond	国債証券	3.5800	3,250	3,731	10,895	2027/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.5500	9,100	9,434	27,547	2020/06/26
通貨小計	銘柄数 金 額	10銘柄		82,800	92,679	270,623	
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	千ペルー・ヌエボソル 380	千ペルー・ヌエボソル 384	千円 11,958	2024/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	305	364	11,329	2026/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	7.8400	310	341	10,618	2029/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	255	278	8,664	2037/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	480	529	16,474	2031/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.2000	230	226	7,048	2023/09/12
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		1,960	2,123	66,094	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 910	千ポーランド・ズロチ 1,086	千円 27,925	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	780	815	20,961	2017/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000	620	692	17,793	2019/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000	1,030	1,013	26,054	2020/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,180	1,141	29,333	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	920	917	23,574	2021/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	650	625	16,064	2018/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	680	666	17,138	2021/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	620	701	18,038	2020/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	570	670	17,221	2021/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	930	1,018	26,165	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.7500	650	674	17,339	2018/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	940	956	24,580	2018/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	810	844	21,700	2019/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,000	1,034	26,597	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		12,290	12,859	330,489	
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 39,300	千ハンガリー・フォリント 41,638	千円 14,985	2020/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	35,000	35,817	12,890	2018/06/22
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	24,000	24,206	8,712	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	16,000	16,137	5,808	2019/10/30
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	10,000	10,121	3,642	2021/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	7.5000	40,500	49,663	17,873	2020/11/12
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	21,400	23,130	8,324	2017/11/24
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	48,800	59,475	21,405	2023/11/24
	Hungary Government Bond	国債証券	6.5000	58,800	66,870	24,066	2019/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	40,000	50,224	18,075	2022/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	24,000	26,286	9,460	2018/12/20
	Hungary Government Bond	国債証券	4.0000	28,700	30,131	10,844	2018/04/25
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	48,500	58,115	20,915	2025/06/24
通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄		435,000	491,818	177,005	
合 計	銘柄数 金 額	187銘柄				3,355,871	

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

■投資信託財産の構成

2016年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	3,355,871 千円	94.7 %
コール・ローン等、その他	187,847	5.3
投資信託財産総額	3,543,718	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=102.39円、1トルコ・リラ=35.25円、1メキシコ・ペソ=5.55円、1フィリピン・ペソ=2.18円、100コロンビア・ペソ=3.49円、100インドネシア・ルピア=0.79円、1ブラジル・レアル=31.31円、1ルーマニア・レイ=25.24円、1ロシア・ルーブル=1.60円、1マレーシア・リンギット=25.57円、1南アフリカ・ランド=7.02円、1タイ・バーツ=2.92円、1ペルー・ヌエボソール=31.12円、1ポーランド・ズロチ=25.70円、100ハンガリー・フォリント=35.99円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(3,422,024千円)の投資信託財産総額(3,543,718千円)に対する比率は、96.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,575,291,022円
コール・ローン等	116,863,482
公社債(評価額)	3,355,871,415
未収入金	45,359,513
未収利息	49,691,718
前払費用	7,504,894
(B) 負債	126,036,097
未払金	126,025,286
その他未払費用	10,811
(C) 純資産総額(A-B)	3,449,254,925
元本	2,923,660,797
次期繰越損益金	525,594,128
(D) 受益権総口数	2,923,660,797口
1万口当り基準価額(C/D)	11,798円

* 期首における元本額は2,264,504,559円、当期中における追加設定元本額は836,305,797円、同解約元本額は177,149,559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、ダイワ新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)438,574,434円、D-I's新興国債券インデックス26,082,894円、D-Cダイワ新興国債券インデックスファンド2,318,543,334円、ダイワ・インデックスセレクト新興国債券136,749,136円、ダイワ・ノーロード新興国債券ファンド3,710,999円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,798円です。

■損益の状況

当期 自2015年7月7日 至2016年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	192,062,811円
受取利息	192,065,985
支払利息	△ 3,174
(B) 有価証券売買損益	△ 664,118,859
売買益	114,152,004
売買損	△ 778,270,863
(C) その他費用	△ 8,840,810
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 480,896,858
(E) 前期繰越損益金	854,039,268
(F) 解約差損益金	△ 38,506,495
(G) 追加信託差損益金	190,958,213
(H) 合計(D+E+F+G)	525,594,128
次期繰越損益金(H)	525,594,128

(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1期

（決算日 2017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1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00~17:00）

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

<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

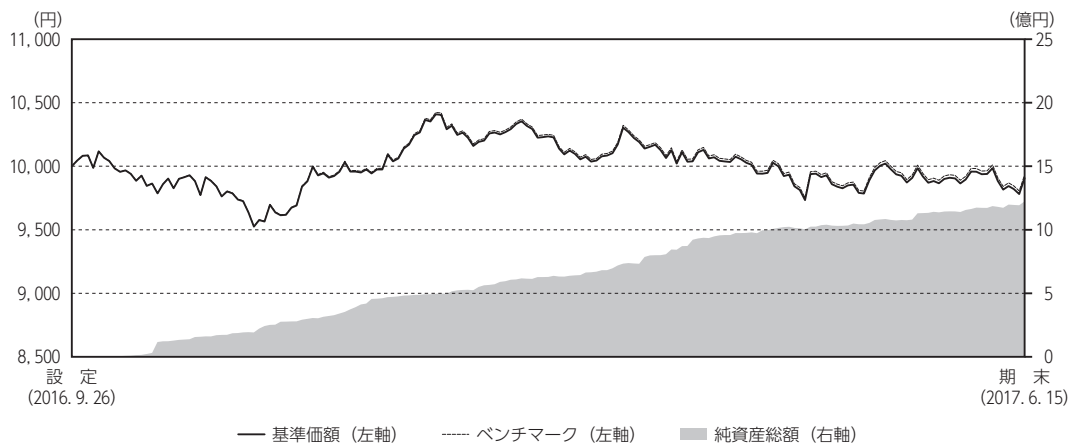
(注1) 投資信託証券および不動産投信指数先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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、設定時を10,000として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

設定時：10,000円

期 末：9,906円

騰落率：△0.9%

■ 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、リート市況が下落したことを反映して、基準価額も下落しました。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		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		
(設定) 2016年 9月26日	10,000	—	(9/23) 3,297.37	—	—	—
9月末	10,117	1.2	3,336.34	1.2	98.7	1.1
10月末	9,913	△ 0.9	3,269.40	△ 0.8	98.3	1.1
11月末	9,996	△ 0.0	3,298.65	0.0	98.3	1.1
12月末	10,365	3.7	3,422.06	3.8	98.7	1.1
2017年 1月末	10,318	3.2	3,407.69	3.3	98.7	1.0
2月末	10,222	2.2	3,376.46	2.4	98.1	1.4
3月末	10,012	0.1	3,307.66	0.3	98.4	1.3
4月末	9,790	△ 2.1	3,234.60	△ 1.9	98.3	1.4
5月末	9,896	△ 1.0	3,271.22	△ 0.8	98.3	1.4
(期末) 2017年 6月15日	9,906	△ 0.9	3,274.94	△ 0.7	98.3	1.4

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2016. 9. 26 ~ 2017. 6. 15)

■国内リート市況

国内リート市況は、設定当初より、米国の金利引き上げ観測の高まりや国内長期金利の上昇などが嫌気され、下落して始まりました。2016年11月の米国大統領選挙後は、米国金利の上昇に伴う国内長期金利の上昇を受けて急落しましたが、日銀が指値オペを実施して過度な金利上昇を抑制する姿勢を示したことや、大手オフィス銘柄が決算発表において堅調な業績見通しを明らかにしたことなどが好感されて上昇に転じました。2017年に入ると、エクイティ・ファイナンスが需給面での重しとなったことや、1月末に日銀による国債買入オペをめぐる思惑で長期金利が上昇したこともあり上値の重い展開となりました。その後も、米国の追加利上げ観測をはじめとして、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、海外投資家や国内リートに投資する投資信託からの資金流出などを背景に、期末にかけて下落基調で推移しました。

ポートフォリオについて

(2016. 9. 26 ~ 2017. 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

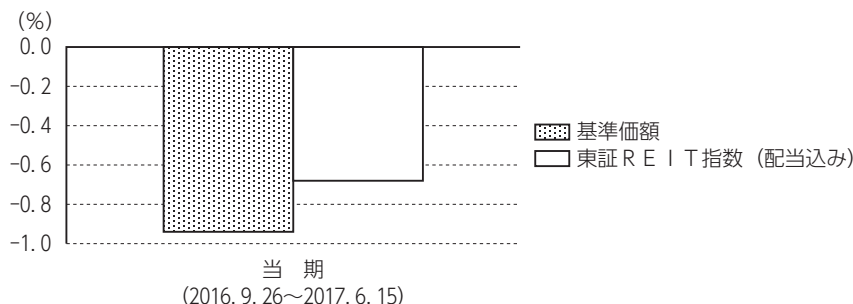
ベンチマーク（東証REIT指数（配当込み））の動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物含む。）については、期を通じて99~100%程度としました。

ベンチマークとの差異について

当期のベンチマーク（東証REIT指数（配当込み））の騰落率は△0.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△0.9%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。

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。



分配金について

当期は、分配対象額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。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2016年9月26日 ～2017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)	—

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



今後の運用方針

■当ファンド

引き続き「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

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（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 (2016.9.26~2017.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	24円	0.241%	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9,995円です。
(投信会社)	(15)	(0.148)	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)	(8)	(0.078)	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)	(0.016)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0.001	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(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／期中の平均受益権総口数 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	0	0.004	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権総口数
(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
合計	25	0.246	

(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

(2016年9月26日から2017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	千口 505,190	千円 1,234,901	千口 2,254	千円 5,513

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) 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

(2016年9月26日から2017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	百万円 595	百万円 2,359	百万円 4,213

(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

(2016年9月26日から2017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 2,546

(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。

■投信会社(自社)による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
百万円 1	百万円 —	百万円 1	百万円 —	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
ダイワJ-REIT マザーファンド	502,936	1,221,783

(注) 単位未満は切捨て。

■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	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	0
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	0
(h) 受益権総口数	1,235,784,993口

■投資信託財産の構成

2017年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワJ-REIT マザーファンド	1,221,783	99.7
コール・ローン等、その他	3,257	0.3
投資信託財産総額	1,225,040	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6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,225,040,819円
コール・ローン等	3,257,535
ダイワJ-REITマザーファンド (評価額)	1,221,783,284
(B) 負債	829,313
未払解約金	27,428
未払信託報酬	788,919
その他未払費用	12,966
(C) 純資産総額 (A - B)	1,224,211,506
元本	1,235,784,993
次期繰越損益金	△ 11,573,487
(D) 受益権総口数	1,235,784,993口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,906円

* 設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は1,295,129,456円、同解約元本額は60,344,463円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,906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11,573,487円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月26日 至2017年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 869円
受取利息	24
支払利息	△ 893
(B) 有価証券売買損益	△ 8,317,383
売買益	179,091
売買損	△ 8,496,474
(C) 信託報酬等	△ 1,549,197
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 9,867,449
(E) 追加信託差損益金	△ 1,706,038
(配当等相当額)	(△) 589
(売買損益相当額)	(△) 1,705,449
(F) 合計 (D + E)	△ 11,573,487
次期繰越損益金 (F)	△ 11,573,487
追加信託差損益金	△ 1,706,038
(配当等相当額)	(△) 589
(売買損益相当額)	(△) 1,705,449
繰越損益金	△ 9,867,449

(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。

<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（2017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（2017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

(2016年9月26日から2017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
ジャパンリアルエステイト	6.322	3,916,911	619,568	大和証券オフィス投資法人	4.142	2,359,890	569,746
日本リテールファンド	15.217	3,508,693	230,577	日本プロロジスリート	4.864	1,162,628	239,027
日本ビルファンド	5.152	3,266,553	634,035	日本ビルファンド	1.896	1,141,041	601,815
ユナイテッド・アーバン投資法人	16.884	2,938,625	174,047	森トラスト総合リート	6.154	1,093,199	177,640
オリックス不動産投資	16.1	2,874,919	178,566	ジャパンリアルエステイト	1.703	999,897	587,138
野村不動産マスターＦ	15.264	2,617,833	171,503	大和ハウスリート投資法人	3.513	994,226	282,981
日本プライムリアルティ	4.353	1,981,553	455,215	野村不動産マスターＦ	5.618	927,584	165,103
三井不動産リート	5.767	1,874,718	325,076	ＧＬＰ投資法人	7.28	918,754	126,202
大和ハウスリート投資法人	6.56	1,873,653	285,617	イオンリート投資	6.517	803,946	123,361
ＡＰＩ投資法人	3.237	1,681,258	519,387	日本リテールファンド	3.46	754,887	218,175

(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、2017年6月15日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（110,682,384千口）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	2017年6月15日現在				ファンド名	2017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				オリックス不動産投資	65.328	11,360,539	4.2		
日本アコモデーションファンド投資法人	11.252	5,474,098	2.0	日本プライムリアルティ	21.378	8,861,181	3.3		
MCUBS MidCity投資法人	6.854	2,392,046	0.9	プレミアム投資法人	30.584	3,764,890	1.4		
森ヒルズリート	36.375	5,172,525	1.9	東急リアル・エステート	22.702	3,148,767	1.2		
産業ファンド	9.199	4,857,072	1.8	グローバル・ワン不動産投資法人	5.436	2,152,656	0.8		
アドバンス・レジデンス	31.35	9,088,365	3.4	ユナイテッド・アーバン投資法人	74.68	12,307,264	4.6		
ケネディクスレジデンシャル	7.68	2,184,960	0.8	森トラスト総合リート	24.2	4,464,900	1.7		
ＡＰＩ投資法人	14.635	7,361,405	2.7	インヴェンシブル投資法人	75.501	4,016,653	1.5		
ＧＬＰ投資法人	59.281	7,421,981	2.8	フロンティア不動産投資	11.518	5,678,374	2.1		
コンフォリア・レジデンシャル	12.349	2,992,162	1.1	平和不動産リート	21.086	1,834,482	0.7		
日本プロロジスリート	39.61	9,597,503	3.6	日本ロジスティクスファンド投資法人	21.511	5,171,244	1.9		
星野リゾート・リート	4.21	2,517,580	0.9	福岡リート投資法人	16.434	2,859,516	1.1		
ONEリート投資法人	3.702	768,165	0.3	ケネディクス・オフィス投資法人	9.897	6,126,243	2.3		
イオンリート投資	29.708	3,704,587	1.4	積水ハウス・レジデンシャル投資法人	25.672	3,060,102	1.1		
ヒューリックリート投資法	21.713	4,012,562	1.5	いちごオフィスリート投資法人	26.219	1,809,111	0.7		
日本リート投資法人	9.098	2,718,482	1.0	大和証券オフィス投資法人	7.302	4,213,254	1.6		
インベスコ・オフィス・Jリート	18.939	1,956,398	0.7	阪急リート投資法人	13.875	1,914,750	0.7		
日本ヘルスケア投資法	1.642	277,333	0.1	スターツプロシード投資法人	5.335	788,513	0.3		
積水ハウス・リート投資	21.24	3,003,336	1.1	大和ハウスリート投資法人	34.825	9,625,630	3.6		
トーセイ・リート投資法人	4.254	457,305	0.2	ジャパン・ホテル・リート投資法人	91.958	7,384,227	2.7		
ケネディクス商業リート	12.312	3,016,440	1.1	日本賃貸住宅投資法人	38.086	3,180,181	1.2		
ヘルスケア&メディカル投資	4.172	415,531	0.2	ジャパンエクセレント投資法人	30.321	4,008,436	1.5		
サムティ・レジデンシャル	5.88	495,684	0.2						
ジャパン・シニアリビング	1.865	267,441	0.1	合計	口数、金額	1,337,627	264,868,804		
野村不動産マスターＦ	97.142	15,921,573	5.9	銘柄数<比率>	58銘柄		<98.5%>		
いちごホテルリート投資	5.352	636,888	0.2						
ラサールロジポート投資	25.545	2,861,040	1.1						
スターアジア不動産投	7.031	711,537	0.3						
マリモ地方創生リート	1.89	179,361	0.1						
三井不動産パーク	5.476	1,828,984	0.7						
大江戸温泉リート	4.307	385,476	0.1						
さくら総合リート	8.14	658,526	0.2						
投資法人みらい	4.308	743,560	0.3						
森トラスト・ホテルリート投	7.333	1,160,813	0.4						
日本ビルファンド	32.79	19,313,310	7.2						
ジャパンリアルエステイト	32.005	18,402,875	6.8						
日本リテールファンド	65.14	14,180,978	5.3						

(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	2017年6月15日現在	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
国内 東証REIT	3,748	—

(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26期 (決算日 2017年3月15日)

(計算期間 2016年9月16日~2017年3月15日)

ダイワJ-REITマザーファンドの第26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。
投資信託証券組入制限	無制限

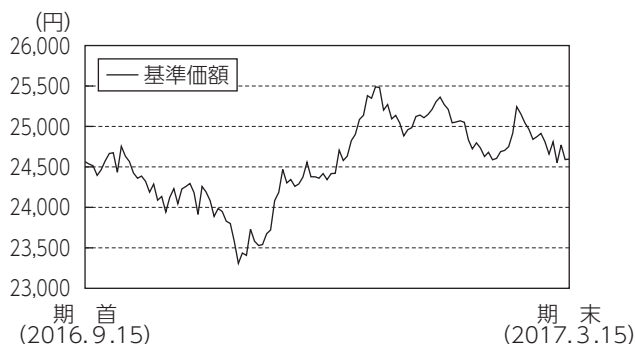
大和投資信託

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)		不動産投資信託先物	
	円	%	円	%	円	%
(期首)2016年9月15日	24,565	-	3,310.77	-	98.9	1.1
9月末	24,754	0.8	3,336.34	0.8	98.9	1.1
10月末	24,258	△1.2	3,269.40	△1.2	98.5	1.1
11月末	24,469	△0.4	3,298.65	△0.4	98.5	1.1
12月末	25,380	3.3	3,422.06	3.4	98.9	1.1
2017年1月末	25,273	2.9	3,407.69	2.9	98.9	1.0
2月末	25,045	2.0	3,376.46	2.0	98.3	1.4
(期末)2017年3月15日	24,597	0.1	3,316.21	0.2	98.6	1.3

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) 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：24,565円 期末：24,597円 騰落率：0.1%

【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、国内長期金利動向の影響を受けた動きとなりましたが、期末の基準価額は期首比でほぼ横ばい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。

◆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、米国の金利引き上げ観測の高まりや国内長期金利の上昇などが嫌気されて、緩やかに下落して始まりました。2016年11月の米国大統領選挙後は、米国金利の上昇に伴う国内長期金利の上昇を受けて急落しましたが、日銀が指値オペを実施して過度な金利上昇を抑制する姿勢を示したことや、大手オフィス銘柄が決算発表において堅調な業績見通しを明らかにしたことなどが好感されて上昇に転じました。2017年に入ると、エウティティ・ファイナンスが需給面での重しとなったことや、1月末に日銀による国債買入オペをめぐる思惑で長期金利が上昇したこともあり上値の重い展開となり、期末にかけて長期金利の変動に影響を受けて一進一退の動きとなりました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク(東証REIT指数(配当込み))の騰落率は0.2%となりました。一方、当ファンドの騰落率は0.1%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)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	-
その他費用	-
合 計	0

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

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2016年9月16日から2017年3月15日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内	千口 232.87	千円 47,039,992	千口 13.554 (-)	千円 2,522,661 (-)

(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) 金額の単位未満は四捨五入してあります。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2016年9月16日から2017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
国内 不動産投資信託先物取引	百万円 7,836	百万円 6,624	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。

★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。）を主要投資対象とします。
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す。</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 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。

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1期

（決算日 2017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1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00~17:00）

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

<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) (参考指数)		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	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 9,844	円 0	% △ 1.6	9,995	% △ 0.1	% 98.2	百万円 5,285

(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。

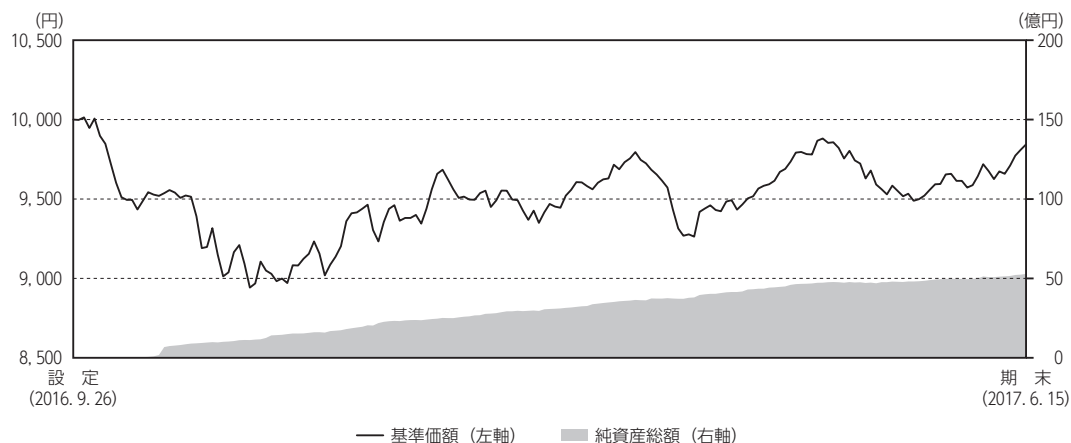
(注2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注3) 投資信託証券組入比率は、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。



運用経過

基準価額等の推移について



■ 基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期末：9,844円

騰落率：△1.6%

■ 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、マザーファンドの保有外貨建て資産を為替ヘッジした結果、海外リート市況が米国等で下落した影響が大きく、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 証 券 組入比率
	円	騰 落 率 %	(参考指数)	騰 落 率 %	
(設定)2016年9月26日	10,000	—	10,000	—	—
9月末	9,898	△ 1.0	9,902	△ 1.0	97.3
10月末	9,198	△ 8.0	9,169	△ 8.3	100.0
11月末	9,233	△ 7.7	9,207	△ 7.9	103.5
12月末	9,439	△ 5.6	9,460	△ 5.4	98.9
2017年1月末	9,369	△ 6.3	9,414	△ 5.9	96.5
2月末	9,795	△ 2.1	9,867	△ 1.3	98.7
3月末	9,517	△ 4.8	9,608	△ 3.9	98.4
4月末	9,723	△ 2.8	9,837	△ 1.6	99.0
5月末	9,572	△ 4.3	9,702	△ 3.0	99.3
(期末)2017年6月15日	9,844	△ 1.6	9,995	△ 0.1	98.2

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2016.9.26 ~ 2017.6.15)

■海外リート市況

米国およびカナダのリート市況は、設定時より、米国の年内利上げ観測が強まったことから米国が特に売られる展開となりました。その後、2016年11月にトランプ氏が米国大統領選挙で当選したことを受けて、インフラ（社会基盤）投資や減税といった景気刺激策への期待を背景に緩やかな上昇に転じました。期末にかけては、トランプ政権に対する政策期待は根強いものの、利上げ懸念がくすぶり、方向感のない動きとなりました。

欧州リート市況は、設定時からECB（欧州中央銀行）の金融緩和策縮小に対する思惑やイタリアの政治的混乱と不良債権問題を受けて、軟調に推移しました。その後も、長期金利の影響を受けて一進一退の値動きとなりました。期末にかけては、フランス大統領選挙の初回投票の結果を受けた安心感で上昇しました。英国は、海外投資家の不動産への需要が旺盛との見方から、2017年4月に大幅に上昇しました。

アジア・オセアニアリート市況は、設定時から、香港およびシンガポールは長期金利上昇の影響および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が、2017年に入ると、米国長期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。オーストラリアも同様に、長期金利が上昇基調だったことから軟調に推移しましたが、好調な国内景気を背景に、買い戻されました。

ポートフォリオについて

(2016.9.26 ~ 2017.6.15)

■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、マザーファンドの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

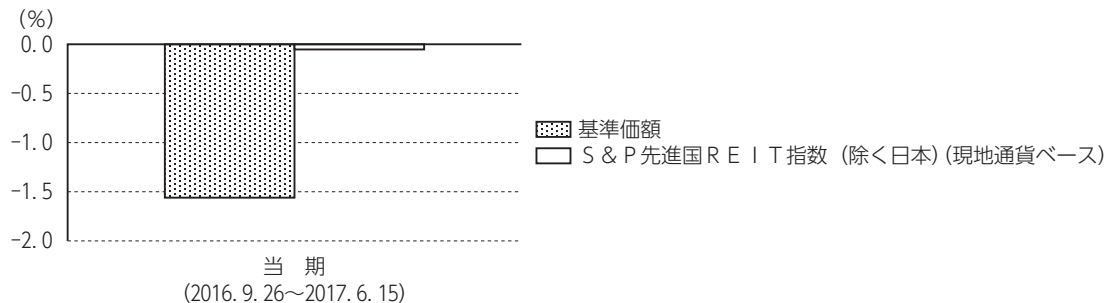
ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウェイトで組成し、ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））との連動性を維持するような運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。

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。



分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2016年9月26日 ～2017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）	389	

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



今後の運用方針

■当ファンド

引き続き「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

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。

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2016.9.26~2017.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	29円	0.307%	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9,505円です。
(投信会社)	(20)	(0.214)	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)	(7)	(0.078)	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)	(0.015)	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	0.031	売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(3)	(0.031)	
有価証券取引税	4	0.041	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
(投資信託証券)	(4)	(0.041)	
その他費用	21	0.222	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)	(21)	(0.221)	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)	(△0.002)	スピンオフに係る税金支払いの戻り、信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	57	0.601	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年9月26日から2017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	2,497,275	5,174,638	76,775	162,190

(注) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	当期末	
	口数	評価額
	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	5,238,930

(注) 単位未満は切捨て。

■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。

■投信会社(自社)による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
10	—	10	—	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017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	5,238,930	98.8
コール・ローン等、その他	65,522	1.2
投資信託財産総額	5,304,452	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=109.72円、1カナダ・ドル=82.89円、1オーストラリア・ドル=83.28円、1香港ドル=14.07円、1シンガポール・ドル=79.70円、1ニュージーランド・ドル=79.51円、1イギリス・ポンド=139.91円、1イスラエル・シケル=31.15円、1ユーロ=123.11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(10,228,394千円)の投資信託財産総額(10,343,324千円)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

2017年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	10,367,937,335円
コール・ローン等	14,871,362
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)	5,238,930,232
未収入金	5,114,135,741
(B)負債	5,082,348,949
未払金	5,069,370,496
未払解約金	8,471,327
未払信託報酬	4,449,619
その他未払費用	57,507
(C)純資産総額 (A - B)	5,285,588,386
元本	5,369,088,014
次期繰越損益金	△ 83,499,628
(D)受益権総口数	5,369,088,014口
1万口当り基準価額 (C/D)	9,844円

*設定時における元本額は10,000,000円、当期中における追加設定元本額は5,609,575,520円、同解約元本額は250,487,506円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,844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83,499,628円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月26日 至2017年6月15日

項 目	当 期
(A)配当等収益	△ 1,230円
受取利息	1
その他収益金	1,970
支払利息	△ 3,201
(B)有価証券売買損益	218,416,780
売買益	461,103,281
売買損	△ 242,686,501
(C)信託報酬等	△ 9,133,290
(D)当期損益金 (A + B + C)	209,282,260
(E)追加信託差損益金	△ 292,781,888
(配当等相当額)	(△ 430)
(売買損益相当額)	(△ 292,781,458)
(F)合計 (D + E)	△ 83,499,628
次期繰越損益金 (F)	△ 83,499,628
追加信託差損益金	△ 292,781,888
(配当等相当額)	(△ 430)
(売買損益相当額)	(△ 292,781,458)
分配準備積立金	209,283,490
繰越損益金	△ 1,230

(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	209,283,490
(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)	209,283,490
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	209,283,490
(h) 受益権総口数	5,369,088,014口

<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（2016年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017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
投資信託証券

(2016年9月26日から2017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
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	18	360,174	20,009	REGENCY CENTERS CORP (アメリカ)	2.2	16,089	7,313
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	8.3	200,575	24,165	NEW YORK REIT INC (アメリカ)	7.7	8,452	1,097
PROLOGIS INC (アメリカ)	29.7	170,599	5,744	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	0.3	6,277	20,925
WELLTOWER INC (アメリカ)	20.4	154,505	7,573	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	0.2	3,831	19,159
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	7.8	153,496	19,679	PROLOGIS INC (アメリカ)	0.5	2,964	5,928
UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)	5.46	144,135	26,398	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	0.4	2,795	6,989
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	20.6	143,528	6,967	ESSEX PROPERTY TRUST INC (アメリカ)	0.1	2,515	25,150
VENTAS INC (アメリカ)	19.9	140,996	7,085	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	0.1	2,437	24,379
BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)	8.5	121,823	14,332	VORNADO REALTY TRUST (アメリカ)	0.2	2,277	11,385
SCENTRE GROUP (オーストラリア)	295.07	107,564	364	WELLTOWER INC (アメリカ)	0.3	2,193	7,311

(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、2017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（4,755,388千口）の内容です。

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	2017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	37.9	33	3,721	0.0
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	5.9	193	21,220	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	6.6	64	7,111	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	8.082	200	21,956	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	8.6	170	18,664	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	11.4	2,226	244,332	2.4
SIMON PROPERTY GROUP INC	26.447	4,221	463,237	4.5
BOSTON PROPERTIES INC	12.7	1,608	176,437	1.7
APARTMENT INVNT & MGMT CO -A	12.955	576	63,239	0.6
GGP INC	48.277	1,160	127,338	1.2
VORNADO REALTY TRUST	14.164	1,332	146,191	1.4
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	13.5	134	14,767	0.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	1.6	33	3,670	0.0
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3.5	79	8,690	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	1.2	30	3,371	0.0
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	6.669	173	18,988	0.2
QTS REALTY TRUST INC-CL A	3.9	205	22,580	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	30.3	2,035	223,374	2.2
APPLE HOSPITALITY REIT INC	12.7	246	27,032	0.3
EPR PROPERTIES	5.3	393	43,160	0.4
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1.7	21	2,391	0.0
CITY OFFICE REIT INC	1.4	17	1,961	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	4.533	103	11,319	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	4.829	123	13,553	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	3.2	64	7,109	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	4.7	115	12,649	0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	2	84	9,245	0.1
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	4.1	269	29,537	0.3
FOREST CITY REALTY TRUST- A	17.7	428	46,978	0.5
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	9	185	20,342	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	0.9	23	2,547	0.0
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	2.213	21	2,386	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	61.1	1,134	124,491	1.2
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	19.308	431	47,369	0.5
GRAMERCY PROPERTY TRUST	12.395	379	41,588	0.4
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	6.3	402	44,107	0.4
CORESITE REALTY CORP	2.8	302	33,203	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	12.8	457	50,235	0.5

ファンド名	2017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	千アメリカ・ドル	千円	%
RLJ LODGING TRUST	10	209	22,931	0.2
FARMLAND PARTNERS INC	1.8	16	1,816	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	12.2	256	28,096	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3.1	44	4,925	0.0
CYRUSONE INC	6.5	378	41,499	0.4
KIMCO REALTY CORP	35.2	677	74,384	0.7
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	15.65	501	55,016	0.5
WHITESTONE REIT	3	37	4,084	0.0
TIER REIT INC	3.9	67	7,411	0.1
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	0.237	2	251	0.0
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	1.1	13	1,471	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	16	583	64,058	0.6
PARKWAY INC	3.488	71	7,860	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	11.6	251	27,593	0.3
COLONY STARWOOD HOMES	7.9	275	30,224	0.3
QUALITY CARE PROPERTIES	7.3	130	14,313	0.1
PARK HOTELS & RESORTS INC	10.1	281	30,873	0.3
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	45.811	649	71,223	0.7
INVITATION HOMES INC	6.3	135	14,861	0.1
WASHINGTON PRIME GROUP INC	14.56	119	13,163	0.1
CORECIVIC INC	9.624	283	31,097	0.3
STORE CAPITAL CORP	14.1	292	32,070	0.3
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	8.2	155	17,013	0.2
LIFE STORAGE INC	3.8	282	31,040	0.3
SELECT INCOME REIT	5	124	13,671	0.1
AMERICAN ASSETS TRUST INC	3.2	130	14,332	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4.782	47	5,157	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	2.5	40	4,427	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	10.1	215	23,681	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	5.2	143	15,775	0.2
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	9.8	216	23,784	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	7.1	199	21,929	0.2
VENTAS INC	29.279	2,011	220,698	2.1
CARETRUST REIT INC	5.703	108	11,901	0.1
GEO GROUP INC/THE	9.9	305	33,564	0.3
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21.6	415	45,597	0.4
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	5.6	128	14,052	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	5.1	119	13,088	0.1
UMH PROPERTIES INC	2.3	39	4,370	0.0
IRON MOUNTAIN INC	20	683	75,026	0.7
TERRENO REALTY CORP	4	132	14,544	0.1
VEREIT INC	79.908	676	74,260	0.7
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	39.4	303	33,286	0.3
SUN COMMUNITIES INC	5.8	518	56,898	0.6
ACADIA REALTY TRUST	6.811	194	21,357	0.2
ALEXANDER'S INC	0.3	128	14,103	0.1
PROLOGIS INC	43.746	2,529	277,573	2.7
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7.3	868	95,289	0.9
BRANDYWINE REALTY TRUST	14	247	27,111	0.3
SAUL CENTERS INC	1	60	6,595	0.1
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	13.445	114	12,539	0.1
MACK-CALI REALTY CORP	7.2	202	22,261	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	7.2	631	69,297	0.7
COUSINS PROPERTIES INC	33.807	304	33,457	0.3
DDR CORP	24.656	227	24,996	0.2
DUKE REALTY CORP	29.2	843	92,494	0.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	2.7	231	25,391	0.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5.467	1,435	157,463	1.5
FELCOR LODGING TRUST INC	10.3	76	8,419	0.1
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	9.5	281	30,842	0.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5.9	749	82,206	0.8
GETTY REALTY CORP	1.903	49	5,485	0.1
WELLTOWER INC	30	2,233	245,026	2.4
HCP INC	38.4	1,227	134,697	1.3
HIGHWOODS PROPERTIES INC	8.4	442	48,524	0.5
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	13.5	407	44,688	0.4
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	9.5	336	36,971	0.4
EQUITY COMMONWEALTH	9.975	319	35,011	0.3
KILROY REALTY CORP	8.1	618	67,908	0.7
LASALLE HOTEL PROPERTIES	9.1	278	30,552	0.3
LIBERTY PROPERTY TRUST	12.1	512	56,264	0.5
LTC PROPERTIES INC	3.1	153	16,819	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	17.7	178	19,634	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	9.428	1,026	112,629	1.1
MACERICH CO/THE	9.9	582	63,935	0.6

ファンド名	2017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	%	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6.7	570	62,639	0.6	
NATL HEALTH INVESTORS INC	3.2	249	27,322	0.3	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	12.2	477	52,445	0.5	
REALTY INCOME CORP	22.417	1,276	140,073	1.4	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	8	286	31,379	0.3	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	5.6	65	7,207	0.1	
PUBLIC STORAGE	12.3	2,581	283,244	2.8	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1.6	211	23,230	0.2	
REGENCY CENTERS CORP	12.12	769	84,429	0.8	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	6.5	87	9,549	0.1	
ISTAR INC	5.6	69	7,618	0.1	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	7.8	209	22,952	0.2	
SL GREEN REALTY CORP	8.3	881	96,750	0.9	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	19.6	420	46,149	0.4	
TAUBMAN CENTERS INC	5	297	32,641	0.3	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2	40	4,434	0.0	
UDR INC	22.1	877	96,265	0.9	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1	76	8,422	0.1	
WP CAREY INC	8.8	592	65,028	0.6	
WASHINGTON REIT	6.1	200	21,979	0.2	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	9.7	309	33,940	0.3	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6.2	40	4,414	0.0	
AGREE REALTY CORP	2.1	101	11,140	0.1	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	16.25	527	57,892	0.6	
CUBESMART	14.8	355	39,005	0.4	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	17.926	294	32,354	0.3	
DIGITAL REALTY TRUST INC	13.2	1,550	170,103	1.7	
CEDAR REALTY TRUST INC	5	26	2,880	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	10.3	776	85,210	0.8	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	4.4	47	5,257	0.1	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	3.475	66	7,347	0.1	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	10.1	62	6,826	0.1	
KITE REALTY GROUP TRUST	6.55	124	13,647	0.1	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	5.7	86	9,443	0.1	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1.1	26	2,872	0.0	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	10.9	524	57,513	0.6	
EDUCATION REALTY TRUST INC	5.9	232	25,486	0.2	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2	43	4,818	0.0	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	16.042	184	20,223	0.2	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	4.449	56	6,199	0.1	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	29.4	391	42,902	0.4	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	8.6	97	10,643	0.1	
DOUGLAS EMMETT INC	11.8	463	50,829	0.5	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	7.6	419	46,029	0.4	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	19.3	245	26,978	0.3	
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額	1,793.781	66,758	7,324,724	
	銘柄数 < 比率 >	158銘柄			<71.2%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円		
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	6.5	85	7,047	0.1	
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	4.9	52	4,317	0.0	
SLATE RETAIL REIT - U	1.7	24	2,055	0.0	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2.6	33	2,756	0.0	
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	0.7	7	644	0.0	
SLATE OFFICE REIT	1	8	669	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2.5	26	2,235	0.0	
BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	0.8	26	2,155	0.0	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1.9	95	7,918	0.1	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	1.1	9	784	0.0	
ONEREIT	1	3	316	0.0	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3.5	28	2,373	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT	4.3	59	4,972	0.0	
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	11.7	80	6,691	0.1	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	0.7	10	896	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2	29	2,465	0.0	
PLAZA RETAIL REIT	2.3	10	901	0.0	
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	5	163	13,544	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5.4	182	15,124	0.1	
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	3	143	11,898	0.1	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	7.89	102	8,515	0.1	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	11.366	258	21,433	0.2	
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	2.3	34	2,821	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13.2	331	27,474	0.3	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4.2	81	6,743	0.1	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2	97	8,111	0.1	

ファンド名	2017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	千カナダ・ドル	千円	
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1.7	35	2,963	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3.7	53	4,394	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	3.3	126	10,503	0.1
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	112,256 29銘柄	2,204 182,731	<1.8%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	16.89	47	3,980	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	106.05	107	8,920	0.1
VIVA ENERGY REIT	33.13	79	6,649	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	11	46	3,893	0.0
PROPERTYLINK GROUP	49.06	40	3,411	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	55.63	132	11,072	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	17.5	60	5,042	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	36.52	53	4,455	0.0
INDUSTRIA REIT	6.5	15	1,277	0.0
GDI PROPERTY GROUP	41.86	44	3,695	0.0
SCENTRE GROUP	440.07	1,892	157,590	1.5
ARENA REIT	14.5	32	2,704	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	10	30	2,498	0.0
BWP TRUST	37.28	120	9,997	0.1
DEXUS	78.73	832	69,369	0.7
GPT GROUP	146.07	763	63,621	0.6
INVESTA OFFICE FUND	49.13	235	19,598	0.2
CHARTER HALL RETAIL REIT	26.37	117	9,750	0.1
MIRVAC GROUP	303.81	695	57,939	0.6
STOCKLAND	198.78	958	79,792	0.8
WESTFIELD CORP	156.75	1,360	113,309	1.1
ABACUS PROPERTY GROUP	21.92	74	6,243	0.1
GOODMAN GROUP	131.62	1,131	94,267	0.9
VICINITY CENTRES	265.89	763	63,551	0.6
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	4.31	28	2,379	0.0
CHARTER HALL GROUP	38.26	226	18,862	0.2
ALE PROPERTY GROUP	13.26	61	5,090	0.0
ASPEN GROUP	3	3	274	0.0
INGENIA COMMUNITIES GROUP	16.33	44	3,699	0.0
360 CAPITAL GROUP LTD	9	8	723	0.0
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,339.22 30銘柄	10,010 833,664	<8.1%>
(香港)	千口	千香港ドル	千円	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	87	407	5,728	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	75	389	5,476	0.1
FORTUNE REIT	110	1,048	14,749	0.1
PROSPERITY REIT	92	308	4,336	0.0
LINK REIT	183	11,638	163,757	1.6
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	53	180	2,535	0.0
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	38	87	1,224	0.0
CHAMPION REIT	168	855	12,031	0.1
香港ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	806 8銘柄	14,914 209,840	<2.0%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円	
KEPPEL DC REIT	63.428	80	6,394	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	40	52	4,208	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	150.1	162	12,979	0.1
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	40.5	57	4,567	0.0
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	75.1	78	6,284	0.1
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	176.6	289	23,083	0.2
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	198.9	537	42,801	0.4
CAPITALAND MALL TRUST	216.6	419	33,403	0.3
SUNTEC REIT	203.8	377	30,049	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	122	145	11,619	0.1
KEPPEL REIT	145.8	165	13,188	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	43.06	60	4,787	0.0
ASCOTT RESIDENCE TRUST	91.9	105	8,423	0.1
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	84.479	48	3,905	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS	54	87	6,950	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	47.9	102	8,131	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	108.7	84	6,714	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	55.8	88	7,026	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	31.1	81	6,518	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	137.4	58	4,654	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	95.18	173	13,844	0.1
CACHE LOGISTICS TRUST	65.5	58	4,698	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	146	227	18,094	0.2

ファンド名	2017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	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	51.5	33	2,667	0.0
SPH REIT	56.5	56	4,503	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	45.8	32	2,591	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	51.9	23	1,861	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	64.2	51	4,118	0.0
OUE HOSPITALITY TRUST	96.673	70	5,586	0.1
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	42.05	30	2,412	0.0
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,802.47 30銘柄	3,840 306,071	<3.0%>
(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	50	4,011	0.0
INVESTORE PROPERTY LTD	10.25	13	1,092	0.0
ARGOSY PROPERTY LTD	59.12	61	4,888	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD	98.95	141	11,289	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	35.31	58	4,632	0.0
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	25.97	58	4,666	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	81.32	102	8,114	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	75.3	92	7,334	0.1
ニュージーランド・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	415.38 8銘柄	578 46,029	<0.4%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	
ASSURA PLC	126.03	81	11,461	0.1
MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	3.7	18	2,588	0.0
CAPITAL & REGIONAL PLC	29.6	17	2,401	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	34.29	39	5,505	0.1
REGIONAL REIT LTD	18.41	19	2,743	0.0
NEWRIVER REIT PLC	17.87	65	9,225	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	13.45	14	2,084	0.0
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	92.73	37	5,231	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	65.36	707	99,035	1.0
HANSTEEN HOLDINGS PLC	59.54	75	10,529	0.1
SEGRO PLC	81.52	410	57,369	0.6
HAMMERSON PLC	65.04	396	55,462	0.5
UNITE GROUP PLC	17.75	120	16,899	0.2
BRITISH LAND CO PLC	84.57	547	76,554	0.7
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	26.14	165	23,113	0.2
INTU PROPERTIES PLC	73.32	198	27,840	0.3
DERWENT LONDON PLC	9.02	260	36,420	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	43.62	50	7,064	0.1
WORKSPACE GROUP PLC	9.39	88	12,349	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	16.56	75	10,528	0.1
SHAFTSBURY PLC	22.23	219	30,728	0.3
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	7.32	16	2,342	0.0
BIG YELLOW GROUP PLC	12.08	99	13,892	0.1
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	55.4	95	13,354	0.1
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	32.2	21	2,939	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	110.93	166	23,342	0.2
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,128.07 26銘柄	4,009 561,009	<5.5%>
(イスラエル)	千口	千イスラエル・シケル	千円	
REIT 1 LTD	9.34	122	3,802	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	122 3,802	<0.0%>
ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千円	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	26.67	37	4,662	0.0
GREEN REIT PLC	54.8	79	9,816	0.1
HIBERNIA REIT PLC	56.65	80	9,868	0.1
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	138.12 3銘柄	197 24,346	<0.2%>
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千円	
WERELDHAVE NV	3.22	142	17,543	0.2
EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	3.92	146	18,039	0.2
NSI NV	11.85	46	5,747	0.1
VASTNED RETAIL NV	1.53	55	6,882	0.1
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	20.52 4銘柄	391 48,213	<0.5%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千円	
AEDIFICA	1.428	110	13,645	0.1
COFINIMMO	1.6	175	21,627	0.2
BEFIMMO	1.73	91	11,319	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	0.85	18	2,307	0.0

ファンド名	2017年6月15日現在			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
RETAIL ESTATES	千口 0.5	千ユーロ 40	千円 4,952	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA	1.23	115	14,212	0.1
WERELDHAVE BELGIUM NV	0.1	9	1,229	0.0
XIOR STUDENT HOUSING NV	0.49	17	2,185	0.0
MONTEA	0.48	23	2,855	0.0
XIOR STUDENT HOUSING NV	0.15	0	46	0.0
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,558 10 銘柄	604 74,383	<0.7%>
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円	
UNIBAIL-RODAMCO SE	8.21	1,916	235,955	2.3
ICADE	3.73	277	34,150	0.3
ALTAREA	0.2	39	4,840	0.0
GECINA SA	3.31	458	56,478	0.5
KLEPIERRE	17.15	646	79,618	0.8
FONCIERE DES REGIONS	4.39	364	44,857	0.4
MERCIALYS	4.49	82	10,104	0.1
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	41.48 7 銘柄	3,785 466,006	<4.5%>
ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千円	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	8.41	105	13,009	0.1
HAMBORNER REIT AG	5.88	55	6,801	0.1
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	14.29 2 銘柄	160 19,810	<0.2%>
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千円	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7.14	56	6,970	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	8.67	126	15,615	0.2
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	5.15	81	9,979	0.1
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	38.52	442	54,487	0.5
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	59.48 4 銘柄	707 87,053	<0.8%>
ユーロ (イタリア)	千口	千ユーロ	千円	
BENI STABILI SPA	82.03	54	6,766	0.1
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZZ	30.4	25	3,102	0.0
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	112.43 2 銘柄	80 9,868	<0.1%>
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	394.878 32 銘柄	5,927 729,682	<7.1%>
合 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,801.395 322 銘柄	— 10,197,556	<99.1%>

(注1) 邦貨換算金額は、2017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。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

運用報告書 第12期（決算日 2016年11月30日）

（計算期間 2015年12月1日～2016年11月30日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	S & P先進国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いません。
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いません。 ②組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。 ③保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行いません。
投資信託証券組入制限	無制限

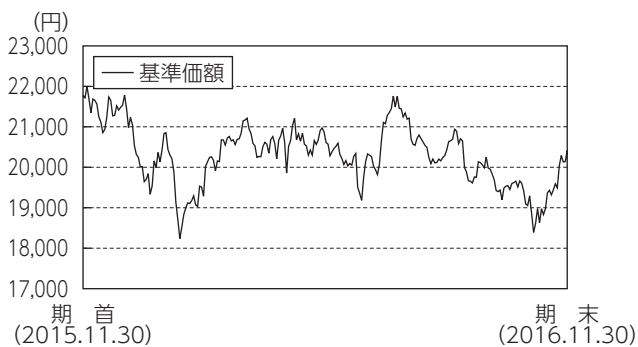
大和投資信託

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）		投資信託証券組入比率
	円	騰落率	（ベンチマーク）	騰落率	%
(期首)2015年11月30日	21,774	-	24,431	-	98.9
12月末	21,783	0.0	24,441	0.0	98.9
2016年1月末	20,429	△ 6.2	22,534	△ 7.8	98.4
2月末	19,512	△ 10.4	22,000	△ 9.9	99.0
3月末	21,168	△ 2.8	23,793	△ 2.6	98.4
4月末	20,619	△ 5.3	23,520	△ 3.7	98.9
5月末	20,972	△ 3.7	23,640	△ 3.2	98.9
6月末	20,140	△ 7.5	22,639	△ 7.3	98.7
7月末	21,341	△ 2.0	24,167	△ 1.1	99.0
8月末	20,634	△ 5.2	23,213	△ 5.0	99.0
9月末	19,981	△ 8.2	22,695	△ 7.1	99.2
10月末	19,054	△ 12.5	21,636	△ 11.4	99.1
(期末)2016年11月30日	20,411	△ 6.3	23,209	△ 5.0	98.9

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）は、S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：21,774円 期末：20,411円 騰落率：△6.3%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は、2016年1月に中国を中心とした株式市場の混乱を

受けて一時下落した後、2月半ば以降は世界的な長期金利の低下を受けて堅調でした。しかし8月からは、米国を中心に長期金利が上昇に転じた影響でリートは売られました。

米国では、2016年に入ると、株式市況の下落や一部不動産関連指標の悪化を受けてリートは下落しました。2月中旬からは、米国の早期追加利上げ観測の後退や雇用統計などの経済指標が堅調だったことを受けて、米国リートは反発しました。4月からしばらくは米国の追加利上げ時期に関する悪感により米国リートは一進一退の動きとなりましたが、6月からは市場予想を上回る経済指標の発表や米国リートの好調な決算が続く再び上昇しました。8月以降は、FRB（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などから米国の早期利上げ観測が強まったため長期金利が上昇したことなどが嫌気され、米国リートは軟調に推移して期末を迎えました。

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

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

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

○為替相場

為替相場は、2016年上半を中心に円高基調でした。

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

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

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウェイトで組成し、S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）との連動性を維持するような運用を行ないました。
具体的には、S & P先進国REIT指数採用銘柄全銘柄に投資しました。期末では、15カ国、320銘柄となっております。

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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、ikai離要因として挙げられます。

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

《今後の運用方針》

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

S & P先進国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を負いません。

■1万口当りの費用の明細

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

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

■主要な売買銘柄
投資信託証券

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

当 期				期			
買	付			売	付		
銘柄	口	金 額	平均単価	銘柄	口	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	7.3	153,342	21,005	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	0.1	2,628	26,280
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	3.5	83,905	23,973	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	0.1	2,325	23,256
PROLOGIS INC (アメリカ)	12.1	64,679	5,345	MACERICH CO/THE (アメリカ)	0.2	1,789	8,945
WELLTOWER INC (アメリカ)	8.4	62,173	7,401	WELLTOWER INC (アメリカ)	0.2	1,589	7,948
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	3.2	59,234	18,510	BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)	0.1	1,505	15,054
VENTAS INC (アメリカ)	8.4	58,836	7,004	SL GREEN REALTY CORP (アメリカ)	0.1	1,420	14,207
UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)	2.2	58,267	26,485	MILESTONE APARTMENTS REAL ES (カナダ)	0.9	1,299	1,443
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	8.4	58,014	6,906	CAMPUS CREST COMMUNITIES INC (アメリカ)	1.3	1,030	792
BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)	3.6	49,084	13,634	INNVEST REAL ESTATE INVESTME (カナダ)	1.7	964	567
SCENTRE GROUP (オーストラリア)	11.9	42,501	357	EXTRA SPACE STORAGE INC (アメリカ)	0.1	959	9,590

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

外国	銘柄	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
		百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル
アメリカ		(1.56)	(2)	1.56	2

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) ()内は株式分割、割当、合併等による増減分、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 金額の単位未満は四捨五入してあります。

(2) 投資信託証券

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

外 国	銘柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ		523.2 (△ 4.402)	18,274 (△ 229)	4.6 (-)	177 (-)
カナダ		32.9 (-)	610 (△ 0)	2.8 (-)	30 (-)
オーストラリア		626.088 (0.6)	2,556 (1)	6 (-)	21 (-)
香港		216 (-)	3,453 (-)	10 (-)	22 (-)
シンガポール		798 (14.201)	1,032 (3)	22.3 (-)	18 (-)
ニュージーランド		117.792 (2.25)	166 (△ 0)	- (-)	- (-)
イギリス		335.911 (3.439)	1,022 (4)	0.2 (-)	2 (-)
イスラエル		2.69 (-)	31 (-)	- (-)	- (-)
ユーロ (アイルランド)		37.9 (-)	49 (-)	- (-)	- (-)
ユーロ (オランダ)		5.196 (-)	104 (-)	0.05 (-)	1 (-)
ユーロ (ベルギー)		2.644 (-)	173 (△ 0)	- (-)	- (-)
ユーロ (フランス)		12.8 (△ 0.2)	1,048 (△ 6)	0.4 (-)	7 (-)
ユーロ (ドイツ)		4.266 (-)	45 (△ 1)	- (-)	- (-)
ユーロ (スペイン)		22 (0.675)	220 (2)	- (-)	- (-)
ユーロ (イタリア)		27.25 (-)	15 (△ 0)	- (-)	- (-)
ユーロ (ユーロ 通貨計)		112.056 (0.475)	1,657 (△ 6)	0.45 (-)	9 (-)

(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、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、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。

■組入資産明細表

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

ファン ド 名	当 期 末			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド				
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
MANULIFE US REAL ESTATE INV	24.9	20	2,323	0.0
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3.1	87	9,876	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	3.6	36	4,103	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	3,982	108	12,247	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	4.8	83	9,400	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6.2	1,021	114,838	2.2
SIMON PROPERTY GROUP INC	14,147	2,578	289,930	5.5
BOSTON PROPERTIES INC	6.9	864	97,163	1.9
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	6,955	292	32,878	0.6
GENERAL GROWTH PROPERTIES	26,277	674	75,801	1.4
VORNADO REALTY TRUST	7,764	769	86,497	1.7
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	7.2	75	8,490	0.2
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	0.9	17	1,968	0.0
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1.6	33	3,739	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.6	12	1,383	0.0
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	3,769	90	10,207	0.2
QTS REALTY TRUST INC-CL A	2.1	100	11,294	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	16.5	998	112,204	2.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	6.8	127	14,364	0.3
EPR PROPERTIES	2.8	198	22,292	0.4
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	0.6	7	883	0.0
CITY OFFICE REIT INC	0.7	8	992	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	7.5	58	6,610	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	2,629	51	5,810	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	1.7	33	3,734	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	2.5	58	6,579	0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	0.9	42	4,823	0.1
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2.3	133	14,958	0.3
FOREST CITY REALTY TRUST- A	9.4	176	19,803	0.4
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4.7	98	11,069	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	0.5	11	1,256	0.0
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	0,813	10	1,150	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	33.4	577	64,958	1.2
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	9,808	207	23,276	0.4
GRAMERCY PROPERTY TRUST	18,287	167	18,872	0.4
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	3.3	139	15,663	0.3
CORESITE REALTY CORP	1.5	106	12,013	0.2
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	4.6	160	18,068	0.3
RLJ LODGING TRUST	5.4	121	13,689	0.3
FARMLAND PARTNERS INC	0.5	5	665	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	5.9	109	12,290	0.2
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1.5	21	2,455	0.0
CYRUSONE INC	3.2	141	15,857	0.3
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	1.4	24	2,747	0.1
KIMCO REALTY CORP	18.9	492	55,328	1.1
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	6,15	177	19,987	0.4
WHITESTONE REIT	1	13	1,527	0.0
TIER REIT INC	2.1	33	3,808	0.1
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	1.9	3	352	0.0
GAMING AND LEISURE PROPTIE	8.6	267	30,077	0.6
PARKWAY INC	1,788	33	3,813	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	6.3	124	14,002	0.3
COLONY STARWOOD HOMES	2.2	66	7,446	0.1
QUALITY CARE PROPERTIES	4.1	60	6,784	0.1
WASHINGTON PRIME GROUP INC	8,06	83	9,432	0.2
CORECIVIC INC	5,224	116	13,078	0.3
STORE CAPITAL CORP	6.9	173	19,539	0.4
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3.9	55	6,243	0.1
LIFE STORAGE INC	2.1	172	19,401	0.4
SELECT INCOME REIT	2.8	70	7,960	0.2
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1.8	73	8,229	0.2
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	2,782	24	2,727	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUNA	1	13	1,571	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	5.4	109	12,287	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	2.7	60	6,814	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	5.3	112	12,631	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	3.4	81	9,116	0.2
VENTAS INC	15,779	963	108,330	2.1
CARETRUST REIT INC	2,603	37	4,228	0.1
NEW YORK REIT INC	7.2	70	7,924	0.2
GEO GROUP INC/THE	3.3	109	12,338	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	11.5	288	32,411	0.6
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	3.2	60	6,856	0.1

ファン ド 名	当 期 末			
	□ 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	%
SABRA HEALTH CARE REIT INC	2.7	60	6,820	0.1
UMH PROPERTIES INC	1	13	1,496	0.0
IRON MOUNTAIN INC	10.9	367	41,331	0.8
TERRENO REALTY CORP	2	54	6,102	0.1
VEREIT INC	42,908	365	41,098	0.8
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	21.3	236	26,603	0.5
SUN COMMUNITIES INC	3	220	24,734	0.5
ACADIA REALTY TRUST	3,411	114	12,826	0.2
ALEXANDER'S INC	0.2	85	9,559	0.2
PROLOGIS INC	23,746	1,221	137,320	2.6
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3.5	391	43,958	0.8
BRANDYWINE REALTY TRUST	7.6	117	13,251	0.3
SAUL CENTERS INC	0.5	32	3,623	0.1
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,645	91	10,304	0.2
MACK-CALI REALTY CORP	4	108	12,249	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	3.9	309	34,750	0.7
COUSINS PROPERTIES INC	14,807	119	13,416	0.3
DDR CORP	13,656	208	23,427	0.4
DUKE REALTY CORP	15.8	407	45,844	0.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	1.5	103	11,635	0.2
EQUITY ONE INC	4	119	13,458	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,967	640	72,003	1.4
FELCOR LODGING TRUST INC	5.6	39	4,488	0.1
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5.1	136	15,388	0.3
FEDERAL REALTY INVST TRUST	3.2	453	51,011	1.0
GETTY REALTY CORP	1,103	26	2,990	0.1
WELLTOWER INC	16.1	1,033	116,181	2.2
HCP INC	21.1	624	70,213	1.3
HIGHWOODS PROPERTIES INC	4.3	209	23,522	0.4
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	7.3	214	24,168	0.5
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5.2	155	17,479	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	5,475	160	18,040	0.3
KILROY REALTY CORP	4.2	309	34,774	0.7
LASALLE HOTEL PROPERTIES	4.9	134	15,121	0.3
LIBERTY PROPERTY TRUST	6.6	262	29,478	0.6
LTC PROPERTIES INC	1.8	83	9,387	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	9.4	98	11,116	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,424	321	36,109	0.7
MACERICH CO/THE	5.4	373	41,978	0.8
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3.6	254	28,596	0.5
NATL HEALTH INVESTORS INC	1.7	123	13,890	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6.6	283	31,897	0.6
REALTY INCOME CORP	11,517	653	73,463	1.4
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4.1	119	13,449	0.3
PENN REAL ESTATE INVEST TST	3.1	59	6,649	0.1
POST PROPERTIES INC	2.4	159	17,950	0.3
PUBLIC STORAGE	6.7	1,404	157,881	3.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	6.9	102	11,476	0.2
REGENCY CENTERS CORP	4.6	307	34,596	0.7
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	3.5	60	6,795	0.1
ISTAR INC	3.2	40	4,532	0.1
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	4.2	147	16,558	0.3
SL GREEN REALTY CORP	4.5	477	53,639	1.0
SENIOR HOUSING PROP TRUST	10.6	193	21,795	0.4
TAUBMAN CENTERS INC	2.7	199	22,391	0.4
URSTADT BIDDLE - CLASS A	1.2	27	3,129	0.1
UDR INC	11.9	406	45,739	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.6	36	4,069	0.1
WP CAREY INC	4.7	279	31,406	0.6
WASHINGTON REIT	3.3	103	11,608	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	5.1	182	20,468	0.4
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	3.1	21	2,401	0.0
AGREE REALTY CORP	1	45	5,111	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8,65	256	28,793	0.6
CUBESMART	7.8	193	21,746	0.4
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	9,426	136	15,354	0.3
DIGITAL REALTY TRUST INC	7.2	673	75,681	1.4
CEDAR REALTY TRUST INC	2.9	19	2,148	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,6	396	44,603	0.9
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	2.2	21	2,431	0.0
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,775	35	4,000	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	4.7	30	3,418	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	3,75	91	10,320	0.2
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	3	43	4,920	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.5	12	1,386	0.0

ファンド名	□	期 末		比 率
		評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
		千口	千円	%
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	5.8	275	30,945	0.6
EDUCATION REALTY TRUST INC	3.2	131	14,756	0.3
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1.1	21	2,406	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	8,742	91	10,250	0.2
NORTHSTAR REALTY FINANCE	7.85	120	13,493	0.3
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,649	28	3,213	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	13.9	169	19,032	0.4
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	4.7	59	6,742	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	6.4	238	26,786	0.5
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	4.1	190	21,368	0.4
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	10.3	159	17,936	0.3
アメリカ・ ドル通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	954,218 159銘柄	33,730 3,791,999	<72.5%>
(カナダ)		千口	千円	%
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	3.2	37	3,146	0.1
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	2.6	23	1,986	0.0
SLATE RETAIL REIT - U	0.5	7	597	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1.5	18	1,518	0.0
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	0.4	4	356	0.0
SLATE OFFICE REIT	0.6	4	392	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	1.3	12	1,061	0.0
BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	0.5	12	1,072	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1	44	3,685	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	1.1	8	710	0.0
ONEREIT	1	3	293	0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1.3	9	788	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	1.9	25	2,117	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	5.2	27	2,297	0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	0.4	5	459	0.0
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	1.8	33	2,763	0.1
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1.4	21	1,813	0.0
PLAZA RETAIL REIT	1.7	8	711	0.0
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	2.7	85	7,114	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2.9	89	7,471	0.1
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	1.6	72	6,094	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	3.79	53	4,455	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	6,166	134	11,243	0.2
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	1	13	1,166	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7.1	191	16,011	0.3
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2.3	41	3,460	0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1	44	3,694	0.1
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	1	18	1,581	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1.9	26	2,195	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1.8	61	5,155	0.1
カナダ・ ドル通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	60,656 30銘柄	1,140 95,421	<1.8%>
(オーストラリア)		千口	千円	%
FOLKSTONE EDUCATION TRUST	9	21	1,802	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	56.5	51	4,373	0.1
GENERATION HEALTHCARE REIT	5.5	9	793	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	31	65	5,503	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	8.5	25	2,167	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	21	31	2,676	0.1
INDUSTRIA REIT	6.5	13	1,115	0.0
GDI PROPERTY GROUP	21	20	1,722	0.0
360 CAPITAL OFFICE FUND	2.5	5	458	0.0
CENTRE GROUP	237	997	83,952	1.6
ARENA REIT	10	17	1,510	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	6.5	17	1,487	0.0
BWP TRUST	21	59	5,035	0.1
DEXUS PROPERTY GROUP	42.5	383	32,255	0.6
GPT GROUP	79.5	376	31,639	0.6
INVESTA OFFICE FUND	27.5	117	9,903	0.2
CHARTER HALL RETAIL REIT	14.5	60	5,124	0.1
MIRVAC GROUP	163.5	333	28,064	0.5
STOCKLAND	105	450	37,900	0.7
WESTFIELD CORP	85	775	65,225	1.2
ABACUS PROPERTY GROUP	12	35	2,958	0.1
GOODMAN GROUP	70	459	38,695	0.7
VICINITY CENTRES	144.5	411	34,650	0.7
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	2.5	16	1,396	0.0
CHARTER HALL GROUP	18	81	6,830	0.1
ALE PROPERTY GROUP	7.5	32	2,700	0.1
ASPEN GROUP	3	3	257	0.0
INGENIA COMMUNITIES GROUP	8	21	1,837	0.0
360 CAPITAL GROUP LTD	5.5	4	414	0.0
オーストラリア・ ドル通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	1,224.5 29銘柄	4,902 412,455	<7.9%>

ファンド名	□	期 末		比 率
		評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		千口	千円	%
YUOXIU REAL ESTATE INVESTMEN	43	184	2,668	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	44	202	2,934	0.1
FORTUNE REIT	59	525	7,622	0.1
PROSPERITY REIT	48	149	2,164	0.0
LINK REIT	100	5,290	76,705	1.5
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	34	108	1,577	0.0
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	29	59	862	0.0
CHAMPION REIT	93	409	5,933	0.1
香港 ドル通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	450 8銘柄	6,928 100,468	<1.9%>
(シンガポール)		千口	千円	%
KEPPEL DC REIT	35,028	42	3,333	0.1
FIRST REAL ESTATE INVST TRUST	21	26	2,114	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	79.2	76	6,004	0.1
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	22.5	28	2,221	0.0
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	45	41	3,251	0.1
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	94.7	142	11,255	0.2
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	103.3	238	18,844	0.4
CAPITALAND MALL TRUST	119	227	17,949	0.3
SUNTEC REIT	112	187	14,814	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	65.8	65	5,170	0.1
KEPPEL REIT	76.5	80	6,343	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	23.26	29	2,341	0.0
ASCOTT RESIDENCE TRUST	40	45	3,569	0.1
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	47,479	25	1,987	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS	29.2	38	3,043	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	24.7	47	3,774	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	58.5	44	3,487	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	30	41	3,257	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	16.8	39	3,157	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	76.6	28	2,238	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	51.48	82	6,504	0.1
CACHE LOGISTICS TRUST	34.7	27	2,205	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	77	110	8,725	0.2
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	35.8	20	1,625	0.0
SPH REIT	30.7	29	2,303	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	30.6	19	1,546	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	22.9	12	949	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	35.5	24	1,948	0.0
OUE HOSPITALITY TRUST	46,673	29	2,358	0.0
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	17.45	11	930	0.0
シンガポール・ ドル通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	1,503.37 30銘柄	1,864 147,257	<2.8%>
(ニュージーランド)		千口	千円	%
STRIDE PROPERTY GROUP	15	28	2,251	0.0
INVESTORE PROPERTY LTD	7.75	11	889	0.0
ARGOSY PROPERTY LTD	33	34	2,793	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	55.5	79	6,413	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	18.5	28	2,301	0.0
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	14	28	2,291	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	43.5	54	4,346	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	44.5	53	4,285	0.1
ニュージーランド・ ドル通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	231.75 8銘柄	318 25,572	<0.5%>
(イギリス)		千口	千円	%
ASSURA PLC	70.7	41	5,834	0.1
MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	2.55	11	1,665	0.0
CAPITAL & REGIONAL PLC	20.65	11	1,588	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	20.6	22	3,182	0.1
REGIONAL REIT LTD	6.65	7	1,018	0.0
NEWRIVER REIT PLC	10.1	33	4,759	0.1
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	54.65	20	2,832	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	35.6	347	48,753	0.9
HANSTEEN HOLDINGS PLC	32.2	34	4,785	0.1
SEGREO PLC	36.6	153	21,519	0.4
HAMMERSON PLC	34.65	190	26,768	0.5
BRITISH LAND CO PLC	45.2	271	38,092	0.7
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	15.2	92	12,927	0.2
INTU PROPERTIES PLC	39.8	108	15,183	0.3
DERWENT LONDON PLC	4.9	117	16,497	0.3
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	25.85	28	4,021	0.1
WORKSPACE GROUP PLC	5.1	35	4,964	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	9.15	31	4,433	0.1
SHAFTESBURY PLC	12.3	112	15,799	0.3
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	3.3	5	838	0.0
BIG YELLOW GROUP PLC	6.4	42	6,013	0.1
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	27.2	39	5,570	0.1

ファンド名	当 期 末			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
千円	千イギリス・ポンド	千円	%	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	22.45	13	1,836	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	47.85	63	8,851	0.2
イギリス・ポンド通貨計	□数、金額 589.65 銘柄数<比率> 24銘柄	1,834	257,738	< 4.9%>
(イスラエル)	千円	千イスラエル・シケル	千円	%
REIT 1 LTD	5.79	65	1,918	0.0
イスラエル・シケル通貨計	□数、金額 5.79 銘柄数<比率> 1銘柄	65	1,918	< 0.0%>
ユーロ (アイルランド)	千円	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	15.15	17	2,103	0.0
GREEN REIT PLC	29.5	36	4,413	0.1
HIBERNIA REIT PLC	30.3	35	4,297	0.1
国 小 計	□数、金額 74.95 銘柄数<比率> 3銘柄	90	10,815	< 0.2%>
ユーロ (オランダ)	千円	千ユーロ	千円	%
WERELDHAVE NV	1.75	69	8,372	0.2
EUROCOMMERCIAL PROPRIET-CV	2.1	72	8,672	0.2
NSI NV	5.75	20	2,415	0.0
VASTNED RETAIL NV	0.8	27	3,323	0.1
国 小 計	□数、金額 10.4 銘柄数<比率> 4銘柄	190	22,784	< 0.4%>
ユーロ (ベルギー)	千円	千ユーロ	千円	%
AEDIFICA	0.6	41	4,962	0.1
COFINIMMO	0.9	94	11,284	0.2
BEFIMMO	1	52	6,256	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	0.55	12	1,520	0.0
RETAIL ESTATES	0.25	18	2,210	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA	0.7	56	6,731	0.1
WERELDHAVE BELGIUM NV	0.1	10	1,304	0.0
XIOR STUDENT HOUSING NV	0.15	5	630	0.0
MONTEA	0.25	10	1,287	0.0
国 小 計	□数、金額 4.5 銘柄数<比率> 9銘柄	302	36,189	< 0.7%>
ユーロ (フランス)	千円	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO SE	4.4	927	111,076	2.1
ICADE	2	129	15,508	0.3
ALTAREA	0.1	17	2,106	0.0
GECINA SA	1.8	221	26,512	0.5
KLEPIERRE	9.25	326	39,140	0.7
FONCIERE DES REGIONS	2.2	162	19,500	0.4
MERCIALYS	2.4	43	5,257	0.1
国 小 計	□数、金額 22.15 銘柄数<比率> 7銘柄	1,830	219,102	< 4.2%>
ユーロ (ドイツ)	千円	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4.45	51	6,221	0.1
HAMBORNER REIT AG	3.45	29	3,557	0.1
国 小 計	□数、金額 7.9 銘柄数<比率> 2銘柄	81	9,778	< 0.2%>
ユーロ (スペイン)	千円	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	4	28	3,370	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	4.7	50	6,081	0.1
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	2.55	33	3,995	0.1
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	20.75	197	23,598	0.5
国 小 計	□数、金額 32 銘柄数<比率> 4銘柄	309	37,046	< 0.7%>
ユーロ (イタリア)	千円	千ユーロ	千円	%
BENI STABILI SPA	45.35	22	2,701	0.1
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZI	11.9	7	891	0.0
国 小 計	□数、金額 57.25 銘柄数<比率> 2銘柄	30	3,593	< 0.1%>
ユーロ通貨計	□数、金額 209.15 銘柄数<比率> 31銘柄	2,834	339,309	< 6.5%>
合 計	□数、金額 5,229,084 銘柄数<比率> 320銘柄	-	5,172,139	<98.9%>

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

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託証券	千円 5,172,139	% 98.1
コール・ローン等、その他	102,792	1.9
投資信託財産総額	5,274,931	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.42円、1カナダ・ドル=83.68円、1オーストラリア・ドル=84.14円、1香港ドル=14.50円、1シンガポール・ドル=78.97円、1ニュージーランド・ドル=80.25円、1イギリス・ポンド=140.46円、1イスラエル・シケル=29.32円、1ユーロ=119.70円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産(5,171,658千円)の投資信託財産総額(5,274,931千円)に対する比率は、98.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年11月30日現在

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

*期首における元本額は1,271,978,733円、当期中における追加設定元本額は1,361,526,489円、同解約元本額は70,457,025円です。
*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジあり) 825,263,014円、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジなし) 75,812,669円、D-1's グローバルREITインデックス1,488,344円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 23,511円、iFree 外国REITインデックス38,800,747円、iFree 8資産バランス 30,296,829円、DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド 1,282,593,048円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 4,056,551円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 5,867,167円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 946,555円、ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT 280,634,605円、ダイワ・ノロード グローバルREITファンド17,265,157円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は20,411円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月1日 至2016年11月30日

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

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

★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。）を主要投資対象とします。
マザーファンドの運用方法	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。	
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 （為替ヘッジなし）

運用報告書（全体版） 第1期

（決算日 2017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1期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00~17:00）

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

<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) (ベンチマーク)		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	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 10,729	円 0	% 7.3	% 7.8	% 99.1	百万円 609	

(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。

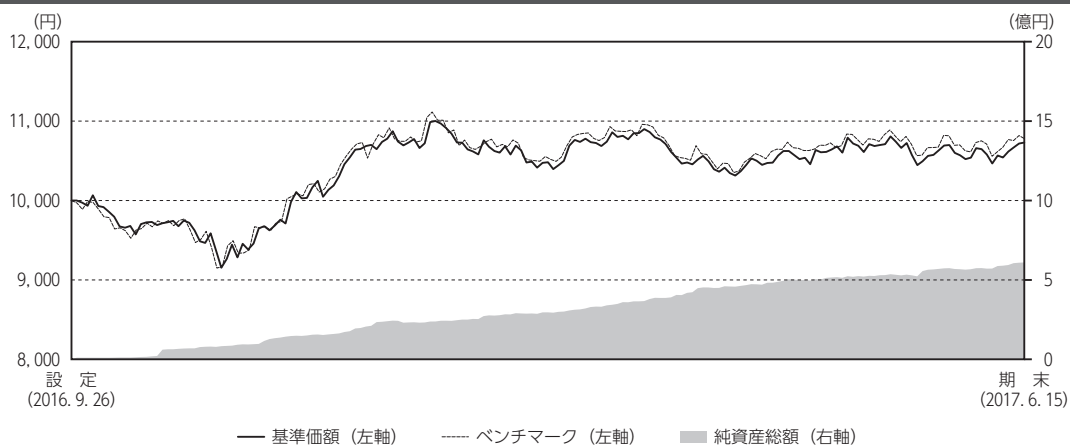
(注3) 投資信託証券組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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、設定時を10,000として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

設定時：10,000円

期末：10,729円

騰落率：7.3%

■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、対米ドルなどで円安が進んだことから、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 証 券 組入比率
	円	騰 落 率 %	(ベンチマーク)	騰 落 率 %	
(設定)2016年9月26日	10,000	—	10,000	—	—
9月末	9,931	△ 0.7	9,974	△ 0.3	98.7
10月末	9,466	△ 5.3	9,509	△ 4.9	99.1
11月末	10,164	1.6	10,200	2.0	98.8
12月末	10,720	7.2	10,752	7.5	98.4
2017年1月末	10,479	4.8	10,538	5.4	98.9
2月末	10,846	8.5	10,890	8.9	99.1
3月末	10,531	5.3	10,532	5.3	99.0
4月末	10,689	6.9	10,767	7.7	98.9
5月末	10,521	5.2	10,626	6.3	99.6
(期末)2017年6月15日	10,729	7.3	10,780	7.8	99.1

(注) 騰落率は設定比。

投資環境について

(2016.9.26 ~ 2017.6.15)

■海外リート市況

米国およびカナダのリート市況は、設定時より、米国の年内利上げ観測が強まったことから米国が特に売られる展開となりました。その後、2016年11月にトランプ氏が米国大統領選挙で当選したことを受けて、インフラ（社会基盤）投資や減税といった景気刺激策への期待を背景に緩やかな上昇に転じました。期末にかけては、トランプ政権に対する政策期待は根強いものの、利上げ懸念がくすぶり、方向感のない動きとなりました。

欧州リート市況は、設定時からECB（欧州中央銀行）の金融緩和策縮小に対する思惑やイタリアの政治的混乱と不良債権問題を受けて、軟調に推移しました。その後も、長期金利の影響を受けて一進一退の値動きとなりました。期末にかけては、フランス大統領選挙の初回投票の結果を受けた安心感で上昇しました。英国は、海外投資家の不動産への需要が旺盛との見方から、2017年4月に大幅に上昇しました。

アジア・オセアニアリート市況は、設定時から、香港およびシンガポールは長期金利上昇の影響および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が、2017年に入ると、米国長期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。オーストラリアも同様に、長期金利が上昇基調だったことから軟調に推移しましたが、好調な国内景気を背景に、買い戻されました。

■為替相場

為替相場は、設定時から、米国の利上げ観測などを受けて米ドル高が進行しました。その後、2016年11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことや12月の米国の利上げにより金利が上昇し、大きく円安が進みました。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月には欧州の政治リスクが後退したことから円安に転じましたが、5月はトランプ大統領のロシアとの不透明な関係をめぐる疑惑への懸念が高まったことなどから、主に米ドルが下落しました。

ポートフォリオについて

(2016. 9. 26 ~ 2017. 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 (S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)) との連動性を維持するような運用を行ないました。

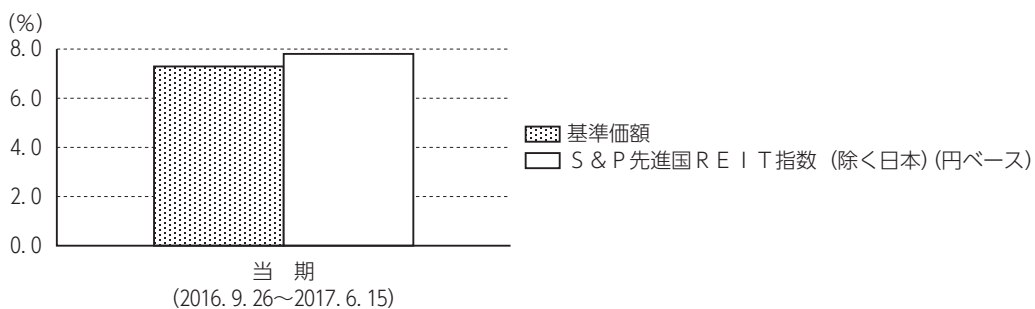
ベンチマークとの差異について

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7.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は7.3%となりました。

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	
	2016年9月26日 ~2017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)		729

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



今後の運用方針

■当ファンド

引き続き、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

引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。リートの組入比率は、期を通じて原則として98%以上で運用を行ないます。

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2016.9.26~2017.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	32円	0.307%	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10,387円です。
(投信会社)	(22)	(0.214)	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)	(8)	(0.078)	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)	(0.016)	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	0.030	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(3)	(0.030)	
有価証券取引税	4	0.040	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権総口数 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
(投資信託証券)	(4)	(0.040)	
その他費用	23	0.220	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権総口数
(保管費用)	(23)	(0.222)	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)	(△1)	(△0.007)	スピンオフに係る税金支払いの戻り、信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	62	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

(2016年9月26日から2017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	285,875	596,419	4,170	9,014

(注) 単位未満は切捨て。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
10	—	10	—	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■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。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	当 期 末	
	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	609,721

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017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	609,721	99.9
コール・ローン等、その他	623	0.1
投資信託財産総額	610,345	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=109.72円、1カナダ・ドル=82.89円、1オーストラリア・ドル=83.28円、1香港ドル=14.07円、1シンガポール・ドル=79.70円、1ニュージーランド・ドル=79.51円、1イギリス・ポンド=139.91円、1イスラエル・シケル=31.15円、1ユーロ=123.11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(10,228,394千円)の投資信託財産総額(10,343,324千円)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

2017年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	610,345,397円
コール・ローン等	623,550
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)	609,721,847
(B) 負債	501,490
未払信託報酬	495,131
その他未払費用	6,359
(C) 純資産総額(A-B)	609,843,907
元本	568,394,416
次期繰越損益金	41,449,491
(D) 受益権総口数	568,394,416口
1万口当り基準価額(C/D)	10,729円

*設定時における元本額は10,000,000円、当期中における追加設定元本額は593,727,416円、同解約元本額は35,333,000円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,729円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月26日 至2017年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 148円
受取利息	3
支払利息	△ 151
(B) 有価証券売買損益	20,762,558
売買益	22,306,143
売買損	△ 1,543,585
(C) 信託報酬等	△ 961,608
(D) 当期損益金(A+B+C)	19,800,802
(E) 追加信託差損益金	21,648,689
(配当等相当額)	(△ 62)
(売買損益相当額)	(21,648,751)
(F) 合計(D+E)	41,449,491
次期繰越損益金(F)	41,449,491
追加信託差損益金	21,648,689
(配当等相当額)	(△ 62)
(売買損益相当額)	(21,648,751)
分配準備積立金	19,800,950
繰越損益金	△ 148

(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、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	19,800,950
(c) 収益調整金	21,648,751
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	41,449,701
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	41,449,701
(h) 受益権総口数	568,394,416口

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の第12期にかかる運用状況については246~250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（2016年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017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。