

# 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。<br>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。<br>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。<br>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<br>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

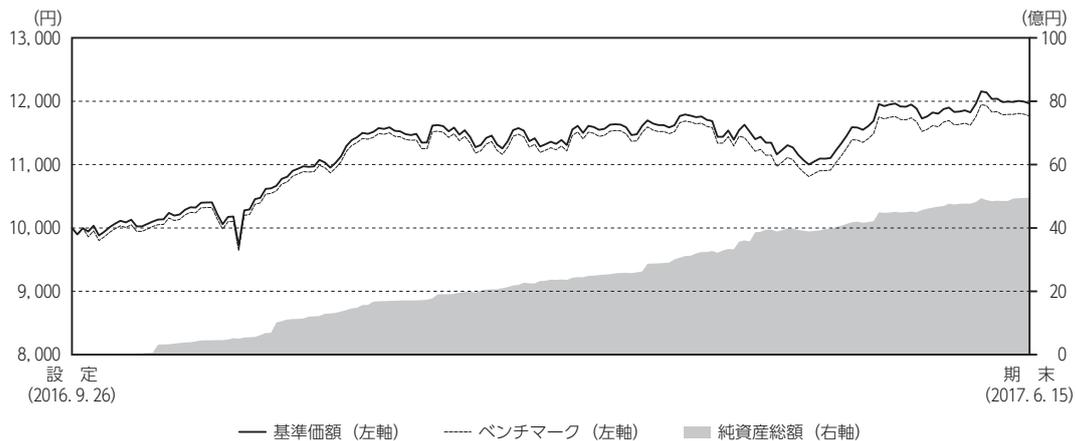
| 決算期                | 基準価額        |           | TOPIX     |                      | 株式組入比率    | 株式先物比率    | 純資産総額    |              |
|--------------------|-------------|-----------|-----------|----------------------|-----------|-----------|----------|--------------|
|                    | 税込み<br>分配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

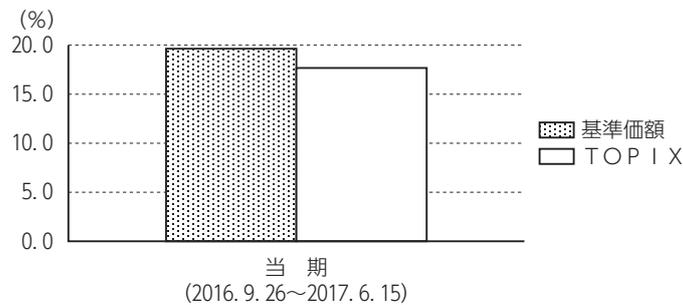
## ベンチマークとの差異について

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<br>～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<br>(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<br>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<br>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<br>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<br>千口 | 金 額<br>千円 | 口 数<br>千口 | 金 額<br>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<br>A    | うち利害<br>関係人との<br>取引状況B | B/A    | 売付額等<br>C     | うち利害<br>関係人との<br>取引状況D | D/C      |
| 株式      | 百万円<br>4,530 | 百万円<br>—               | %<br>— | 百万円<br>11,186 | 百万円<br>40              | %<br>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<br>10            | 百万円<br>26 | 百万円<br>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<br>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 |

## &lt;補足情報&gt;

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

(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        |
| <b>水産・農林業 (0.1%)</b> |              |         | 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  | 若築建設              | 57           | 9,576   | 森永製菓           | 12.5         | 90,000  | ミヨシ油脂               | 61           | 8,845     |
| <b>鉱業 (0.3%)</b>     |              |         | 東洋建設              | 20.7         | 8,838   | 中村屋            | 2.1          | 10,479  | 理研ピタミン              | 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 | <b>繊維製品 (0.7%)</b>  |              |           |
| 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 | 日本基電              | 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    |
| <b>建設業 (3.2%)</b>    |              |         | 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  | オエ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  | <b>パルプ・紙 (0.3%)</b> |              |           |
| 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   | <b>食料品 (4.8%)</b> |              |         | 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  |                     |              |           |

| 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<br>千株 千円 |                       | 株数           | 評価額<br>千株 千円 |                        | 株数           | 評価額<br>千株 千円 |                  | 株数           | 評価額<br>千株 千円 |
| <b>化学 (6.9%)</b> |              |              | ノビアホールディングス           | 3.2          | 17,728       | 三ツ星ベルト                 | 10           | 11,630       | 長府製作所            | 6.3          | 17,280       |
| クラレ              | 97.5         | 197,047      | コニシ                   | 9.8          | 15,141       | バンドー化学                 | 7.6          | 8,040        | リンナイ             | 10           | 101,900      |
| 旭化成              | 366          | 408,090      | 長谷川香料                 | 7.5          | 16,845       | <b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b> |              |              | 岡部               | 12.9         | 12,900       |
| 共和レザー            | 3.6          | 3,412        | 星光PMC                 | 5.8          | 7,232        | 日東紡績                   | 47           | 24,487       | ジーテクト            | 6.2          | 12,493       |
| 昭和電工             | 41.8         | 102,117      | 小林製薬                  | 15.3         | 104,958      | 旭硝子                    | 290          | 271,150      | 東ブレ              | 10.9         | 32,307       |
| 住友化学             | 432          | 253,152      | 荒川化学工業                | 5.5          | 10,917       | 日本板硝子                  | 32           | 26,976       | 高周波熱練            | 11.7         | 11,969       |
| 住友精化             | 2.6          | 13,780       | メック                   | 5.7          | 7,102        | 日本山村硝子                 | 34           | 6,120        | 東京製綱             | 4.5          | 7,537        |
| 日産化学             | 32.1         | 119,893      | 日本高純度化学               | 3.8          | 8,755        | 日本電気硝子                 | 119          | 89,488       | バイオラックス          | 9.1          | 27,227       |
| ラサ工業             | 82           | 11,316       | タカラバイオ                | 16           | 24,368       | 住友大阪セメント               | 111          | 54,168       | 日本発条             | 54.6         | 63,936       |
| クレハ              | 4.3          | 23,220       | JCU                   | 4.2          | 16,338       | 太平洋セメント                | 359          | 129,599      | 三益半導体            | 4.7          | 8,210        |
| テイカ              | 11           | 10,648       | 新田セラチン                | 8.9          | 6,470        | 日本ヒューム                 | 8.7          | 5,889        | <b>機械 (5.0%)</b> |              |              |
| 石原産業             | 12.6         | 13,230       | デクセラリアルズ              | 15.6         | 15,397       | 日本コンクリート               | 17.4         | 6,681        | 日本製綱所            | 20.5         | 34,788       |
| 日東エフシー           | 1.7          | 1,531        | アース製薬                 | 4.4          | 25,300       | アジアパイルHD               | 11.4         | 8,265        | 三浦工業             | 24.1         | 52,489       |
| 日本曹達             | 35           | 20,650       | 北興化学                  | 15           | 7,095        | 東海カーボン                 | 58.6         | 36,800       | タグマ              | 19.1         | 20,532       |
| 東ソー              | 169          | 178,971      | 大成ラミック                | 3.5          | 10,258       | 日本カーボン                 | 36           | 12,960       | ツガミ              | 17.1         | 13,107       |
| トクヤマ             | 99           | 49,401       | クミアイ化学                | 26.1         | 16,808       | 東洋炭素                   | 3.7          | 6,911        | オークマ             | 38           | 38,076       |
| セントラル硝子          | 59           | 26,963       | 日本農業                  | 15           | 9,435        | ノリタケ                   | 3.4          | 12,291       | 東芝機械             | 35           | 17,640       |
| 東亜合成             | 34.7         | 45,422       | アキレス                  | 2.5          | 4,752        | TOTO                   | 42.9         | 182,754      | アマダホールディングス      | 74.3         | 94,138       |
| 大阪ソーダ            | 26           | 13,728       | 有沢製作所                 | 12.2         | 10,455       | 日本碍子                   | 72.4         | 155,732      | アイダエンジニア         | 17           | 17,697       |
| 関東電化             | 12.9         | 11,274       | 日東電工                  | 42.3         | 375,750      | 日本特殊陶業                 | 50.7         | 114,176      | 滝澤鉄工所            | 54           | 9,126        |
| デンカ              | 116          | 63,800       | レック                   | 4.8          | 13,372       | MA R UWA               | 3.3          | 14,470       | 富士機械製造           | 19           | 30,096       |
| 信越化学             | 104.7        | 1,042,393    | きもと                   | 26.2         | 6,392        | 品川フラクトリース              | 24           | 6,648        | 牧野フライス           | 29           | 26,100       |
| 日本カーバイド          | 68           | 10,948       | 藤森工業                  | 4.5          | 15,435       | 黒崎播磨                   | 15           | 6,345        | オーエスジー           | 26.2         | 57,011       |
| 堺化学              | 17           | 7,157        | 前澤化成工業                | 8.5          | 10,506       | フジニコーポレーテッド            | 5.1          | 11,418       | 旭ダイヤモンド          | 17.6         | 14,027       |
| エア・ウォーター         | 47.3         | 92,282       | ジェイ エス ピー             | 2.4          | 6,960        | ニチアス                   | 32           | 41,824       | DMG森精機           | 34.4         | 58,067       |
| 大陽日酸             | 45           | 52,920       | エフピコ                  | 5.4          | 33,156       | ニチハ                    | 8.1          | 33,250       | ソディック            | 14.3         | 16,988       |
| 日本化学工業           | 26           | 5,564        | 天馬                    | 1.8          | 3,666        | <b>鉄鋼 (1.1%)</b>       |              |              | ディスコ             | 6.8          | 123,556      |
| 日本カーライズ          | 29.7         | 50,044       | 信越ポリマー                | 12.7         | 10,248       | 新日鐵住金                  | 266.1        | 622,940      | 日東工業             | 3.7          | 9,301        |
| 高圧ガス             | 10.4         | 8,351        | 東リ                    | 21.3         | 8,008        | 神戸製鋼所                  | 105.6        | 108,240      | OKK              | 6.1          | 7,564        |
| 四国化成             | 9            | 12,195       | ニフコ                   | 10.2         | 60,690       | 中山製鋼所                  | 7.5          | 4,687        | 島精機製作所           | 8.1          | 40,257       |
| 戸田工業             | 16           | 4,336        | 日本バルカー                | 5.7          | 12,294       | 合同製鐵                   | 3.7          | 6,500        | ブリュー             | 4.2          | 5,523        |
| ステラケミファ          | 3.6          | 10,227       | ユニ・チャーム               | 119.5        | 351,031      | JFEホールディングス            | 161.8        | 288,084      | 日阪製作所            | 6.5          | 6,051        |
| 保土谷化学            | 2.7          | 10,948       | <b>医薬品 (4.6%)</b>     |              |              | 日新製鋼                   | 18.9         | 22,604       | やまびこ             | 11.6         | 13,827       |
| 日本触媒             | 9.2          | 64,400       | 協和発酵キリン               | 70.3         | 142,006      | 東京製鐵                   | 30.2         | 26,153       | ペガサスマシン製造        | 8.6          | 6,045        |
| 大日精化             | 21           | 18,207       | 武田薬品                  | 219.1        | 228,371      | 共英製鋼                   | 6.4          | 10,816       | ナプテスコ            | 30.4         | 98,952       |
| カネカ              | 78           | 64,818       | アステラス製薬               | 597.3        | 816,210      | 大和工業                   | 11.3         | 30,080       | 三井海洋開発           | 7            | 16,758       |
| 三菱瓦斯化学           | 53.2         | 116,986      | 大日本住友製薬               | 40.9         | 69,284       | 東京製鋼                   | 16           | 6,464        | レオン自動機           | 6.6          | 7,246        |
| 三井化学             | 263          | 148,332      | 塩野義製薬                 | 73.4         | 445,317      | 大阪製鐵                   | 3            | 6,258        | SMC              | 17.7         | 605,340      |
| JSR              | 58.9         | 106,785      | 田辺三菱製薬                | 68.3         | 169,384      | 淀川製鋼                   | 6.8          | 19,992       | 新川               | 7.1          | 4,998        |
| 東京応化工業           | 11.2         | 42,392       | あすか製薬                 | 7            | 11,606       | 東洋鋼鋸                   | 14.8         | 5,816        | ホソカワミクロン         | 2.6          | 12,389       |
| 大阪有機化学           | 6.2          | 8,760        | 日本新薬                  | 13.5         | 92,880       | 丸一鋼管                   | 18.8         | 61,664       | ユニオンツール          | 2.7          | 8,613        |
| 三菱ケミカル HLDGS     | 392.7        | 334,816      | 中外製薬                  | 58.4         | 240,900      | 大同特殊鋼                  | 98           | 59,682       | オイレス工業           | 6.9          | 13,103       |
| ダイヤセル            | 80.9         | 100,963      | 科研製薬                  | 10.9         | 64,528       | 日本高周波                  | 87           | 6,960        | サトーホールディングス      | 8.2          | 21,393       |
| 住友ベークライト         | 51           | 38,913       | イーザイ                  | 71.8         | 437,118      | 日本冶金工                  | 62.4         | 14,040       | 日精樹脂工業           | 6.2          | 6,572        |
| 積水化学             | 131.2        | 259,251      | ロート製薬                 | 28.9         | 70,082       | 山陽特殊製鋼                 | 35           | 20,405       | 小松製作所            | 271          | 727,364      |
| 日本ゼオン            | 50           | 54,000       | 小野薬品                  | 135.8        | 328,975      | 愛知製鋼                   | 3.3          | 13,612       | 住友重機械            | 167          | 118,570      |
| アイカ工業            | 17.7         | 58,144       | 久光製薬                  | 16.6         | 92,130       | 日立金属                   | 59.7         | 84,893       | 日立建機             | 26.1         | 68,199       |
| 宇部興産             | 294          | 79,968       | 持田製薬                  | 4            | 31,720       | 大平洋金属                  | 36           | 10,116       | 巴工業              | 4.9          | 8,849        |
| 積水樹脂             | 7.8          | 16,270       | 参天製薬                  | 106.2        | 159,406      | 新日本電工                  | 46.8         | 16,988       | 井関農機             | 62           | 13,950       |
| タキロンシーアイ         | 15           | 9,015        | 扶桑薬品                  | 2.7          | 7,522        | 栗本鉄工所                  | 2.9          | 5,559        | TOWA             | 5.6          | 9,206        |
| 旭有機材             | 8            | 1,992        | 日本ケミフア                | 1.2          | 6,384        | 日本鋳鉄管                  | 25           | 4,225        | 丸山製作所            | 4.3          | 7,520        |
| 日立化成             | 32.1         | 97,744       | ツムラ                   | 19.6         | 91,140       | 三菱製鋼                   | 39           | 9,633        | 北川鉄工所            | 3.5          | 8,050        |
| ニチパン             | 7            | 6,671        | 日医工                   | 14.5         | 24,650       | シンニッパン                 | 5.3          | 3,736        | ローツェ             | 2.7          | 7,354        |
| リケンテクノス          | 13.5         | 7,911        | キッセイ薬品工業              | 10.2         | 29,345       | <b>非鉄金属 (0.9%)</b>     |              |              | クボタ              | 279.1        | 532,383      |
| 大倉工業             | 22           | 13,376       | 生化学工業                 | 10.8         | 19,774       | 大紀アルミニウム               | 14           | 8,120        | 三菱化工機            | 21           | 5,523        |
| 積水化成成品           | 7.4          | 6,304        | 栄研化学                  | 5            | 16,075       | 日本軽金属HD                | 128.6        | 33,564       | 月島機械             | 9.7          | 12,202       |
| 群栄化学             | 1.8          | 6,606        | 日水製薬                  | 3.8          | 5,396        | 三井金属                   | 169          | 69,290       | 帝国電機製作所          | 6.7          | 7,591        |
| タイガース ポリマー       | 5.9          | 4,425        | 鳥居薬品                  | 4.2          | 11,491       | 東邦亜鉛                   | 36           | 15,264       | 新東工業             | 14.3         | 15,844       |
| ダイキョーニシカワ        | 10.5         | 15,456       | JCRファーマ               | 5.3          | 14,241       | 三菱マテリアル                | 37.1         | 114,824      | 渋谷工業             | 5.4          | 17,496       |
| 日本化薬             | 37           | 58,682       | 東和薬品                  | 3            | 15,600       | 住友鉱山                   | 155          | 206,150      | アイチコーポレーション      | 9.2          | 7,065        |
| カライトホールディングス     | 13.2         | 7,616        | 富士製薬工業                | 2.6          | 10,088       | DOWAホールディングス           | 66           | 53,394       | 小森コーポレーション       | 13.4         | 18,840       |
| 日本精化             | 7.6          | 7,410        | 沢井製薬                  | 10.2         | 61,812       | 古河機金                   | 88           | 16,544       | 鶴見製作所            | 4.4          | 7,612        |
| 扶桑化学工業           | 4.4          | 16,940       | ゼリア新薬工業               | 11.9         | 20,610       | 大阪チタニウム                | 7.6          | 12,289       | 住友精密             | 12           | 4,188        |
| ADEKA            | 23.5         | 39,151       | 第一三共                  | 169.9        | 413,961      | 東邦チタニウム                | 10.5         | 7,885        | 荏原製作所            | 27.2         | 81,872       |
| 日油               | 42           | 59,514       | キョーリン製薬HD             | 13.8         | 32,347       | UACJ                   | 96           | 27,936       | 西島製作所            | 7.5          | 8,152        |
| 花王               | 147          | 1,012,389    | 大幸薬品                  | 4            | 7,556        | 古河電工                   | 20.1         | 100,902      | 北越工業             | 10           | 9,060        |
| 第一工業製薬           | 19           | 9,348        | ダイト                   | 3.8          | 9,002        | 住友電工                   | 217.8        | 375,705      | ダイキン工業           | 76.8         | 842,880      |
| 三洋化成             | 3.4          | 17,612       | 大塚ホールディングス            | 126.7        | 613,734      | フジクラ                   | 75.7         | 72,823       | オルガン             | 16           | 8,800        |
| 大日本塗料            | 37           | 10,545       | 大正製薬HD                | 12.4         | 106,516      | 昭和電線 HLDGS             | 122          | 10,004       | トーヨーカネツ          | 30           | 9,300        |
| 日本ペイント HOLD      | 45.1         | 180,174      | ペプチドリーム               | 11           | 77,990       | タツタ電線                  | 15.7         | 8,697        | 栗田工業             | 31.9         | 96,497       |
| 関西ペイント           | 61.7         | 151,350      | <b>石油・石炭製品 (0.5%)</b> |              |              | リョービ                   | 36           | 16,272       | 椿本チエイン           | 30           | 27,690       |
| 中国塗料             | 16.3         | 13,251       | 日本コーク工業               | 78.6         | 7,624        | アールステイ                 | 9.3          | 9,885        | アネスト岩田           | 11.1         | 10,744       |
| 日本特殊塗料           | 4.3          | 6,983        | 昭和シエル石油               | 52.6         | 55,808       | アサヒHD                  | 8.8          | 16,121       | ダイフコ             | 28.2         | 92,496       |
| 藤倉化成             | 11.1         | 7,092        | ニチレキ                  | 9.2          | 11,205       | <b>金属製品 (0.7%)</b>     |              |              | 加藤製作所            | 3.6          | 10,818       |
| 太陽ホールディングス       | 4.7          | 23,382       | ユシロ化学                 | 3.7          | 5,439        | 稲葉製作所                  | 0.8          | 1,122        | 油研工業             | 38           | 8,664        |
| DI C             | 23           | 86,365       | 富士石油                  | 15.8         | 5,166        | 宮地エンジニアリングG            | 31           | 7,719        | タダノ              | 29.5         | 38,173       |
| サカタインクス          | 11.7         | 20,498       | MORESCO               | 3.8          | 7,573        | トーカロ                   | 3.9          | 13,962       | フジテック            | 15.8         | 20,492       |
| 東洋インキSCホールディング   | 53           | 29,998       | 出光興産                  | 27.8         | 88,404       | SUMCO                  | 62.7         | 107,279      | CKD              | 17.3         | 29,427       |
| T&K TOKA         | 6.3          | 7,402        | JXTGホールディングス          | 899.4        | 436,658      | 川田テクノロジーズ              | 1.4          | 9,506        | キート              | 8.2          | 9,241        |
| 富士フイルム HLDGS     | 116          | 463,768      | コスモエネルギーHLDGS         | 19.2         | 32,908       | 東洋製糖グループHD             | 39.7         | 73,405       | 平和               | 17.2         | 41,761       |
| 資生堂              | 112.1        | 433,602      | <b>ゴム製品 (1.0%)</b>    |              |              | ホクサンホールディングス           | 20           | 8,800        | 理想科学工業           | 5            | 10,585       |
| ライオン             | 73.7         | 181,302      | 横浜ゴム                  | 35.2         | 75,820       | 横河ブリッジ HLDGS           | 10.9         | 17,658       | SANKYO           | 14.2         | 53,392       |
| 高砂香料             | 4.1          | 17,302       | 東洋ゴム                  | 32.3         | 66,376       | 駒井ハルテック                | 2.8          | 6,171        | 日本金銭機械           | 6.5          | 7,527        |
| マンダム             | 6            | 36,060       | ブリヂストン                | 197.5        | 931,015      | 三和ホールディングス             | 58.3         | 71,534       | マースエンジニアリング      | 1.8          | 4,339        |
| ミルボン             | 3.3          | 20,559       | 住友ゴム                  | 54.2         | 102,058      | 文化山ヤッター                | 17           | 14,263       | 福島工業             | 3.8          | 16,321       |
| ファンケル            | 12.9         | 27,399       | 藤倉ゴム                  | 12.7         | 8,255        | 三協立山                   | 7.9          | 13,335       | ダイコク電機           | 3.3          | 5,616        |
| コーセー             | 9.6          | 122,880      | オカモト                  | 18           | 24,138       | アルインコ                  | 6.5          | 7,085        | 竹内製作所            | 10.5         | 19,131       |
| シーズ・ホールディングス     | 7.9          | 31,363       | ニッタ                   | 5            | 16,925       | LIXILグループ              | 82.8         | 221,904      | アマノ              | 17.4         | 41,551       |
| ポーラ・オルビス HD      | 24.7         | 76,446       | 住友理工                  | 10.5         | 11,749       | ノーリツ                   | 11.3         | 24,893       | JUUKI            | 9.9          | 14,117       |

| 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       |
| サンデンホールディングス        | 41           | 11,931    | 日本電波工業              | 10.8         | 9,568     | エフテック               | 6.5          | 9,236     | リンテック                  | 12.1         | 30,976    |
| 蛇の目マシン              | 7.3          | 6,467     | 日本トリス               | 1.8          | 7,749     | 武蔵精密工業              | 6.9          | 21,252    | イトーキ                   | 12.6         | 10,873    |
| マックス                | 9            | 14,652    | ローランドディー・ジー         | 4.1          | 10,770    | 日産車体                | 24.1         | 26,437    | 任天堂                    | 34.5         | 1,250,625 |
| グロリー                | 17.7         | 63,720    | フォスター電機             | 7.6          | 12,851    | 新明和工業               | 23           | 20,217    | 三菱鉛筆                   | 4.7          | 29,140    |
| 新発工業                | 4.7          | 8,427     | クラリオン               | 33           | 13,002    | 極東開発工業              | 11.2         | 19,992    | タカスタンダード               | 10.5         | 19,383    |
| 大和冷機工業              | 9.6          | 11,529    | S M K               | 18           | 6,822     | 日信工業                | 12.1         | 21,054    | コクヨ                    | 29.2         | 42,865    |
| セガサミーホールディングス       | 56           | 81,144    | ヨコオ                 | 6.8          | 9,805     | トビー工業               | 4.7          | 14,852    | ナカバヤシ                  | 20           | 5,960     |
| 日本ビストンリング           | 4            | 8,852     | ホシデン                | 19.7         | 23,994    | ティラド                | 27           | 9,072     | グローブライド                | 3.4          | 6,735     |
| リケン                 | 2.8          | 13,426    | ヒロセ電機               | 9            | 139,500   | 曙ブレーキ               | 38.1         | 13,296    | 岡村製作所                  | 18.9         | 19,240    |
| T P R               | 5.8          | 20,503    | 日本航空電子              | 19           | 28,177    | タチエス                | 9.9          | 19,968    | 美津濃                    | 30           | 19,200    |
| ツバキ・ナカシマ            | 6.6          | 14,460    | T O A               | 7.9          | 8,776     | N O K               | 26.7         | 62,718    | <b>電気・ガス業 (1.9%)</b>   |              |           |
| ホンザキ                | 16.4         | 157,932   | 日立マクセル              | 8.9          | 18,725    | フタバ産業               | 21.7         | 18,900    | 東京電力H D                | 484.7        | 221,023   |
| 大豊工業                | 5            | 6,895     | 古野電気                | 12.4         | 8,283     | K Y B               | 63           | 33,642    | 中部電力                   | 183.5        | 277,360   |
| 日本精工                | 114          | 153,330   | エネデンホールディングス        | 67           | 17,018    | 大同メタル工業             | 7.7          | 7,361     | 関西電力                   | 228.3        | 365,280   |
| N T N               | 133          | 65,170    | アルバイ                | 14.7         | 21,903    | アレス工業               | 30.4         | 15,260    | 中国電力                   | 70.5         | 89,112    |
| ジェイテクト              | 58           | 92,278    | スマダコーポレーション         | 7.1          | 11,317    | 太平洋工業               | 11.9         | 16,457    | 北陸電力                   | 49.2         | 52,053    |
| 不二越                 | 56           | 31,192    | アイコム                | 5.4          | 13,791    | ケーヒン                | 12.5         | 18,912    | 東北電力                   | 139.7        | 224,497   |
| 日本トムソン              | 19.6         | 11,250    | リオン                 | 3.4          | 5,627     | ケー工業                | 8.1          | 11,137    | 四国電力                   | 54.7         | 77,236    |
| T H K               | 39           | 120,900   | 船井電機                | 6.7          | 5,721     | アイシン精機              | 51.1         | 283,094   | 九州電力                   | 124.6        | 172,571   |
| ユーシン精機              | 3.3          | 8,926     | 横河電機                | 60.5         | 111,864   | マツダ                 | 179.8        | 269,430   | 北海道電力                  | 52.6         | 45,446    |
| イーグル工業              | 6.2          | 11,197    | 新電元工業               | 24           | 12,912    | 今仙電機製作所             | 8.3          | 9,719     | 沖縄電力                   | 9.3          | 23,910    |
| 日本ビラー工業             | 7.1          | 11,487    | アズビル                | 16.5         | 70,290    | 本田技研                | 503.1        | 1,537,976 | 電源開発                   | 45.6         | 125,947   |
| キッツ                 | 27.8         | 28,022    | 日本光電工業              | 23           | 58,466    | スズキ                 | 111          | 579,087   | イーレックス                 | 8.4          | 8,072     |
| マキタ                 | 73.1         | 299,344   | 共和電業                | 15.4         | 6,745     | SUBARU              | 172.8        | 638,323   | 東京瓦斯                   | 601          | 365,408   |
| 日立造船                | 42           | 22,638    | 堀場製作所               | 10.6         | 72,186    | ヤマハ発動機              | 78.9         | 222,734   | 大阪瓦斯                   | 542          | 247,748   |
| 三菱重工                | 954          | 408,407   | アドバンテスト             | 38.6         | 77,624    | ショーワ                | 20.9         | 22,613    | 東邦瓦斯                   | 138          | 118,542   |
| I H I               | 442          | 168,844   | エスペック               | 5.5          | 9,130     | T B K               | 17           | 8,534     | 北海道瓦斯                  | 21           | 5,670     |
| スター精密               | 9.7          | 15,413    | キーエンス               | 25.2         | 1,238,328 | エクセディ               | 6.7          | 20,435    | 広島ガス                   | 15.4         | 5,405     |
| <b>電気機器 (13.0%)</b> |              |           | 日置電機                | 3.5          | 7,752     | 豊田合意                | 16.2         | 42,314    | 西部瓦斯                   | 63           | 16,758    |
| 日清紡ホールディングス         | 28.3         | 30,535    | シスメックス              | 43.5         | 292,755   | 愛三工業                | 9.8          | 8,643     | 静岡ガス                   | 15.3         | 11,520    |
| イビデン                | 41.8         | 81,760    | 日本マイクロニクス           | 13.5         | 16,308    | ヨロス                 | 5.6          | 9,872     | メタウォーター                | 3.3          | 10,329    |
| コニカミノルタ             | 130.8        | 115,365   | メガチップス              | 6.1          | 15,311    | エフ・シー・シー            | 9.4          | 20,078    | <b>陸運業 (4.3%)</b>      |              |           |
| ブラザー工業              | 72.5         | 182,772   | OBARA GROUP         | 3.4          | 19,278    | シマノ                 | 22.5         | 384,525   | SBSホールディングス            | 6.4          | 5,222     |
| ミネベアミツミ             | 105.7        | 190,894   | コーセル                | 8.7          | 11,675    | テイ・エス テック           | 12.8         | 41,600    | 東武鉄道                   | 298          | 182,376   |
| 日立                  | 1,354        | 893,640   | イリソ電子工業             | 2.8          | 25,592    | ジャムコ                | 3.6          | 8,971     | 相鉄ホールディングス             | 89           | 49,217    |
| 三菱電機                | 599.7        | 938,830   | オプテックスグループ          | 5.3          | 19,981    | <b>精密機器 (1.6%)</b>  |              |           | 東京急行                   | 304          | 254,144   |
| 富士電機                | 177          | 103,722   | 千代田インテグレ            | 3.4          | 7,371     | デルモ                 | 85.7         | 377,508   | 京浜急行                   | 153          | 213,282   |
| 東洋電機製造              | 4.7          | 7,440     | レーザーテック             | 12.8         | 22,348    | 日機装                 | 20           | 20,900    | 小田急電鉄                  | 89.9         | 206,770   |
| 安川電機                | 65           | 153,530   | スタンレー電気             | 39.8         | 130,942   | 島津製作所               | 71.8         | 153,149   | 京王電鉄                   | 154          | 146,300   |
| シノフォニアテクノロジー        | 44           | 17,820    | 岩崎電気                | 48           | 8,304     | J M S               | 23           | 7,291     | 京成電鉄                   | 40.6         | 120,988   |
| 明電舎                 | 64           | 23,488    | ウシオ電機               | 34.1         | 48,694    | ファイテクノロジー           | 1.2          | 24,000    | 富士急行                   | 16           | 18,976    |
| 山洋電気                | 16           | 16,912    | 日本セラミック             | 5.3          | 13,976    | 東京計器                | 32           | 8,800     | 新京成電鉄                  | 13           | 5,421     |
| デンヨー                | 5.7          | 11,154    | 遠藤照明                | 10.7         | 12,919    | 東京精密                | 10.7         | 40,713    | 東日本旅客鉄道                | 107.7        | 1,197,624 |
| 東芝テック               | 38           | 22,344    | 古河電池                | 13           | 10,166    | マニー                 | 6.8          | 20,304    | 西日本旅客鉄道                | 53.4         | 428,428   |
| 芝浦メカトロニクス           | 22           | 7,480     | 山一電機                | 6.5          | 11,576    | ニコン                 | 290.2        | 176,552   | 東海旅客鉄道                 | 46.4         | 850,512   |
| マブチモーター             | 15.8         | 90,376    | 図研                  | 5.9          | 9,221     | トプコン                | 100.3        | 54,263    | 西武ホールディングス             | 79.2         | 566,161   |
| 日本電産                | 72.9         | 828,873   | 日本電子                | 25           | 14,525    | オリオパス               | 90.5         | 355,665   | 鴻池運輸                   | 7.9          | 11,889    |
| 東光高岳                | 4.5          | 7,245     | カシオ                 | 46           | 76,958    | 理研計器                | 5.6          | 11,855    | 西日本鉄道                  | 63           | 30,807    |
| ダブル・スコープ            | 6.7          | 11,269    | ファナック               | 56.4         | 1,206,114 | タムロン                | 5            | 9,700     | ハマキョウレックス              | 4.3          | 11,455    |
| ダイヘン                | 31           | 26,226    | 日本シイエムケイ            | 15.8         | 14,504    | H O Y A             | 114.2        | 623,303   | サカイ引越センター              | 2.8          | 12,026    |
| 田淵電機                | 20.6         | 6,097     | エンプラス               | 2.5          | 8,425     | ノーリツ鋼機              | 7.2          | 6,336     | 近鉄グループHLDGS            | 563          | 244,905   |
| J V Cケンウッド          | 54.7         | 16,847    | ローム                 | 27.2         | 227,664   | エー・アンド・デイ           | 12.6         | 5,720     | 阪急阪神HLDGS              | 69.5         | 276,610   |
| 日新電機                | 12.6         | 15,271    | 浜松ホトニクス             | 41.2         | 138,432   | シチズン時計              | 59.1         | 44,384    | 南海電鉄                   | 118          | 70,210    |
| 大崎電気                | 13           | 10,972    | 三井ハイテック             | 8.8          | 15,144    | リズム時計               | 39           | 9,087     | 京阪ホールディングス             | 121          | 86,757    |
| オムロン                | 59.6         | 278,034   | 新光電気工業              | 21.5         | 19,178    | 大研医器                | 6.7          | 5,212     | 神戸電鉄                   | 18           | 7,218     |
| 日東工業                | 7.5          | 13,185    | 京セラ                 | 91.7         | 587,521   | メニコン                | 4.1          | 14,391    | 名古屋鉄道                  | 203          | 105,560   |
| I D E C             | 12.6         | 18,698    | 太陽誘電                | 30.5         | 50,111    | 松風                  | 3.6          | 4,705     | 山陽電鉄                   | 23           | 13,271    |
| ジー・エス・コアコーポ         | 107          | 53,500    | 村田製作所               | 59           | 912,730   | セイコーHD              | 41           | 17,671    | 日本通運                   | 207          | 143,865   |
| サクソホールディングス         | 30           | 6,060     | ユーシン                | 17.3         | 12,715    | ニプロ                 | 38.3         | 54,730    | ヤマトホールディングス            | 100.5        | 228,939   |
| メルコホールディングス         | 4.3          | 13,975    | 双葉電子工業              | 8.8          | 17,063    | <b>その他製品 (2.1%)</b> |              |           | 山丸                     | 68           | 49,096    |
| 日本電気                | 806          | 230,516   | 北陸電気工業              | 57           | 7,695     | パラマウントベッドHD         | 5.4          | 26,217    | 丸全昭和運輸                 | 16           | 7,296     |
| 富士通                 | 546          | 430,248   | ニチコン                | 17.5         | 20,335    | ニホンフラッシュ            | 3.8          | 5,635     | セノーグループHLDGS           | 25.1         | 17,494    |
| 沖電気                 | 27.3         | 43,379    | 日本ケミコン              | 62           | 24,242    | 前田工業                | 6.9          | 10,736    | トナミホールディングス            | 15           | 6,315     |
| 電気興業                | 22           | 12,232    | K O A               | 8.5          | 16,940    | 永大産業                | 13           | 6,630     | ニッコンホールディングス           | 16.6         | 41,915    |
| サンケン電気              | 38           | 17,214    | 市光工業                | 17           | 13,855    | アートネイチャー            | 8.2          | 5,953     | 福山通運                   | 31           | 22,072    |
| アイホン                | 4.1          | 7,638     | 小糸製作所               | 32.7         | 186,063   | ダンロップスポーツ           | 4.4          | 4,853     | セイノーホールディングス           | 37.9         | 56,660    |
| ルネサスエレクトロニクス        | 34.6         | 33,319    | ミツバ                 | 10.7         | 21,453    | パンダイナムコHLDGS        | 61.9         | 239,553   | 神奈川中央交通                | 8            | 5,840     |
| セイコーエプソン            | 83.2         | 195,603   | SCREENホールディングス      | 11.6         | 92,452    | 共立印刷                | 27.1         | 9,214     | 日立物流                   | 11.7         | 30,291    |
| ワコム                 | 60.2         | 20,769    | キャノン電子              | 4.3          | 9,494     | S H O E I           | 3.1          | 8,816     | 丸和運輸機関                 | 1.7          | 6,613     |
| アルバック               | 9.9          | 56,727    | キャノン                | 299.6        | 1,166,942 | フランスペッドHLDGS        | 7.2          | 6,976     | 九州旅客鉄道                 | 55.8         | 206,739   |
| アクセル                | 4.7          | 3,637     | リコー                 | 169          | 161,564   | パイロットコーポレーション       | 9.2          | 42,228    | <b>海運業 (0.2%)</b>      |              |           |
| E I Z O             | 6.8          | 29,206    | 東京エレクトロン            | 37.2         | 592,782   | 萩原工業                | 2.5          | 7,197     | 日本郵船                   | 496          | 101,184   |
| ジャパンディスプレイ          | 122.7        | 24,417    | <b>輸送用機器 (8.4%)</b> |              |           | トッパン・フォームズ          | 9.1          | 10,583    | 商船三井                   | 299          | 95,680    |
| 日本信号                | 16.5         | 16,896    | トヨタ紡織               | 19.5         | 39,955    | フジールインターナショナル       | 12.7         | 37,350    | 川崎汽船                   | 212          | 59,148    |
| 京三製作所               | 21           | 10,710    | ユニプレス               | 10.9         | 27,413    | タカラトミー              | 24.3         | 34,214    | NSユニティド海運              | 30           | 6,510     |
| 能美防災                | 7.3          | 11,468    | 豊田自動織機              | 49.9         | 278,941   | 大建工業                | 4.4          | 10,841    | 飯野海運                   | 30.2         | 14,043    |
| ホーチキ                | 5.8          | 10,092    | モリタホールディングス         | 10.8         | 17,982    | 凸版印刷                | 148          | 183,372   | <b>空運業 (0.6%)</b>      |              |           |
| エレコム                | 6.1          | 15,042    | 三桜工業                | 10.2         | 7,925     | 大日本印刷               | 155          | 191,580   | 日本航空                   | 98.4         | 336,429   |
| 日本無線                | 5.4          | 7,327     | デンソー                | 135.2        | 629,761   | 共同印刷                | 21           | 7,938     | ANAホールディングス            | 1,026        | 397,267   |
| パナソニック              | 646.8        | 939,153   | 東海理化電機              | 14.2         | 28,187    | 日本写真印刷              | 10.5         | 29,841    | <b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b> |              |           |
| アンリツ                | 43.9         | 43,461    | 三井造船                | 197          | 30,141    | 光村印刷                | 30           | 7,740     | トランコム                  | 1.8          | 10,044    |
| 富士通ゼネラル             | 21           | 51,534    | 川崎重工業               | 441          | 139,797   | 宝印刷                 | 3.6          | 5,817     | 日新                     | 26           | 12,662    |
| 日立国際電気              | 15.1         | 39,924    | 名村造船所               | 17.3         | 10,760    | アシックス               | 55.3         | 108,941   | 三菱倉庫                   | 35           | 51,730    |
| ソニー                 | 395.4        | 1,636,165 | 日本車輛                | 34           | 9,860     | ツツミ                 | 1.9          | 4,018     | 三井倉庫 HOLD              | 34           | 10,472    |
| T D K               | 32.1         | 233,367   | 日産自動車               | 663.8        | 716,240   | ヤマハ                 | 38.3         | 135,965   | 住友倉庫                   | 39           | 27,573    |
| 帝国通信工業              | 51           | 10,506    | いすゞ自動車              | 163.1        | 218,635   | 河合楽器                | 2.9          | 6,774     | 渋沢倉庫                   | 28           | 9,800     |
| タムラ製作所              | 24           | 12,360    | トヨタ自動車              | 680          | 3,939,920 | クリナップ               | 7.8          | 6,622     | 東陽倉庫                   | 28           | 8,148     |
| アルプス電気              | 52           | 152,256   | 日野自動車               | 80.6         | 98,976    | ピジヨン                | 34.1         | 140,321   | 日本トランスシティ              | 18           | 8,028     |
| パイオニア               | 101.2        | 20,240    | 三菱自動車工業             | 211.3        | 151,079   | キングジム               | 7.8          | 7,121     | 東洋埠頭                   | 43           | 7,697     |

| 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       |
| 上組                   | 66           | 76,758    | 松竹                | 37           | 52,318    | 神鋼商事              | 1.5          | 3,795   | 一六堂             | 22.1         | 8,508     |
| キューソー流通システム          | 2.3          | 5,798     | 東宝                | 35           | 118,650   | 阪和興業              | 52           | 40,664  | セブン&アイ・HLDGS    | 231.3        | 1,107,001 |
| 郵船ロジスティクス            | 5.7          | 5,717     | 東映                | 20           | 20,940    | カナデン              | 6.5          | 7,241   | 薬王堂             | 3.4          | 12,002    |
| 近鉄エクспレス             | 10           | 18,210    | NTTデータ            | 34.7         | 211,323   | 菱電商事              | 7            | 5,446   | 丸エイト・レストランツ・ホール | 14.5         | 14,572    |
| 東海運                  | 12.7         | 5,334     | DT S              | 6            | 20,100    | 岩谷産業              | 59           | 41,123  | ツルハホールディングス     | 11.4         | 141,018   |
| 内外トランスライン            | 3.6          | 4,680     | スクウェア・エニックス・HD    | 21.5         | 79,335    | すてきなイスグループ        | 45           | 6,840   | サンマルクホールディングス   | 3.6          | 12,474    |
| <b>情報・通信業 (8.1%)</b> |              |           | シーイーシー            | 3.9          | 7,901     | 三菱石油              | 13.7         | 14,850  | トリドールホールディングス   | 7.1          | 20,384    |
| NEC ネットエスアイ          | 6            | 15,054    | カプコン              | 13.5         | 36,922    | 稲畑産業              | 8.5          | 11,900  | ダイユー・リックHLDGS   | 9.5          | 7,410     |
| システナ                 | 5.2          | 12,152    | ジャストテック           | 4.8          | 5,817     | ワキタ               | 12.2         | 14,847  | クスリのオアキHLDGS    | 4.8          | 25,824    |
| デジタルアーツ              | 3            | 11,565    | S C S K           | 15.2         | 75,696    | 東邦ホールディングス        | 17.3         | 37,731  | 総合メディカル         | 3            | 14,955    |
| 新日鉄住金 S O L          | 8.5          | 22,754    | アイネス              | 8.2          | 8,995     | サンゲツ              | 15.3         | 29,590  | ノジマ             | 8.7          | 15,190    |
| ソフトクリエイトHD           | 5.7          | 8,213     | T K C             | 5.4          | 16,848    | ミツウロコグループ         | 7.8          | 5,577   | カッパ・クリエイト       | 8.4          | 10,911    |
| T I S                | 18.5         | 58,367    | 富士ソフト             | 8.5          | 27,157    | シナモンホールディングス      | 1.6          | 3,649   | ライトオン           | 5            | 5,200     |
| 電算システム               | 3            | 5,133     | N S D             | 10.7         | 21,710    | 伊藤忠エネクス           | 9.4          | 8,911   | 良品計画            | 7.4          | 219,484   |
| グリーン                 | 39.8         | 40,118    | コナミホールディングス       | 25.2         | 160,272   | サンリオ              | 16.7         | 34,368  | アドヴァン           | 4.9          | 5,703     |
| コアエテックモHD            | 12.5         | 29,075    | 福井コンピュータHLDGS     | 2            | 7,080     | リョーサン             | 7            | 28,980  | アルビス            | 2.1          | 10,332    |
| 三菱総合研究所              | 2.5          | 7,962     | JBC Cホールディングス     | 12.8         | 10,777    | 新光商事              | 5            | 6,830   | コナカ             | 12.3         | 7,306     |
| ファンデックス              | 6.2          | 5,573     | ミロク情報サービス         | 5.2          | 11,570    | トーホー              | 3.1          | 9,194   | コーナン商事          | 7.7          | 16,308    |
| K L a b              | 12.2         | 19,410    | ソフトバンクグループ        | 249.1        | 2,206,278 | 三信電気              | 6.3          | 8,719   | ワタミ             | 8            | 10,944    |
| ポルトウワイン・ピットル         | 6.2          | 10,812    | <b>卸売業 (4.2%)</b> |              |           | 東陽テクニカ            | 8.3          | 8,715   | ドンキホーテホールディング   | 35.8         | 155,909   |
| ネクソン                 | 60.7         | 135,482   | エレマテック            | 2.6          | 4,607     | モスフード サービス        | 7            | 24,325  | 西松屋チェーン         | 10.1         | 12,261    |
| アイスタイル               | 13.2         | 11,642    | あらた               | 2.9          | 11,281    | 加賀電子              | 5            | 10,655  | ゼンショーホールディングス   | 29.4         | 61,651    |
| エイチーム                | 4.8          | 14,208    | フィールズ             | 4.4          | 5,134     | P A L T A C       | 9.1          | 34,580  | 幸楽苑ホールディングス     | 6            | 10,872    |
| テクノスジャパン             | 4.9          | 5,527     | 双日                | 309.5        | 82,946    | ヤマダ電              | 6            | 9,144   | サイゼリヤ           | 8.3          | 27,224    |
| コプロラ                 | 20.1         | 22,331    | アルファホールディングス      | 65.2         | 139,071   | 丸紅建材リース           | 28           | 6,076   | V Tホールディングス     | 20.5         | 11,172    |
| ブロードリーフ              | 18.3         | 12,645    | 横浜冷凍              | 14.3         | 15,286    | 日鉄住金物産            | 4.1          | 21,279  | ポプラ             | 15.3         | 8,491     |
| ハーツコナジグループ           | 4.8          | 8,016     | 山下医科器械            | 3.3          | 5,705     | トラスコ中山            | 12.8         | 31,180  | ユナイテッドアローズ      | 8.1          | 27,297    |
| ティエーガイア              | 5.6          | 11,860    | アルコニクス            | 5.1          | 9,628     | オートバックスセブン        | 16.3         | 29,193  | ハイデイド日高         | 6.2          | 15,121    |
| 豆蔵ホールディングス           | 7.7          | 7,692     | 神戸物産              | 3.2          | 16,544    | 加藤産業              | 8.6          | 25,972  | 京都きもの友禅         | 10.7         | 9,854     |
| テクマトリックス             | 5.2          | 8,772     | あいホールディングス        | 8.6          | 25,129    | イノテック             | 10.4         | 6,999   | コロワイド           | 18.1         | 34,136    |
| カホー・オンライン・エンター       | 122.7        | 34,969    | ディービーエックス         | 5.6          | 7,380     | イエローハット           | 5.5          | 14,624  | 杏番屋             | 3.1          | 11,981    |
| GMOペイメントゲートウェイ       | 4.7          | 30,503    | ダイワボウHD           | 68           | 26,860    | 白伝                | 2.5          | 9,175   | スギホールディングス      | 12           | 72,720    |
| インターネットイニシアティブ       | 10.3         | 20,919    | マクニカ・富士エスHLDGS    | 10.5         | 17,146    | 因幡電機産業            | 7.2          | 29,340  | スクロール           | 12           | 4,428     |
| さくらインターネット           | 6.2          | 5,797     | パイタルK S K HD      | 9.4          | 8,572     | ミスミグループ本社         | 62.5         | 149,437 | ヨドバシホールディングス    | 5.1          | 14,060    |
| SRAホールディングス          | 3            | 9,030     | UKAホールディングス       | 3.5          | 6,681     | スズケン              | 24.9         | 89,889  | エー・ファミリマートHD    | 24.5         | 162,190   |
| 朝日ネット                | 16.3         | 8,068     | TOKAIホールディングス     | 24.8         | 20,435    | ジェコス              | 5            | 6,000   | 木曾路             | 7            | 19,019    |
| コムチュア                | 1.5          | 8,010     | 三洋貿易              | 4.9          | 11,132    | <b>小売業 (4.8%)</b> |              |         | サトレストラシステムズ     | 13.2         | 11,959    |
| g u m i              | 7.9          | 9,164     | ウイン・パートナーズ        | 5.5          | 7,034     | ローソン              | 18.4         | 142,600 | 千趣会             | 9.6          | 8,092     |
| LINE                 | 12.7         | 49,911    | シップヘルスケアHD        | 10.6         | 34,556    | サンエー              | 4.2          | 21,000  | ケーヨー            | 13.3         | 10,493    |
| 野村総合研究所              | 41.2         | 175,718   | メガホールディングス        | 10.2         | 19,053    | カワチ薬品             | 4.6          | 12,466  | 上新電機            | 13           | 19,552    |
| インテジホールディングス         | 3.7          | 8,084     | 小野建               | 5.3          | 8,824     | エーピーシー・マート        | 10.2         | 66,912  | 日本瓦斯            | 10.3         | 37,852    |
| フジ・メディア・HD           | 57.5         | 84,122    | 佐島電機              | 7            | 5,684     | ハードオフコーポレーション     | 4.4          | 5,007   | ロイヤルホールディングス    | 8.8          | 22,686    |
| オービック                | 19.2         | 121,728   | 伯東                | 6.8          | 9,465     | アスフル              | 6.1          | 20,160  | いなげや            | 5.4          | 10,033    |
| ジャストシステム             | 9.8          | 16,493    | コンドーテック           | 7.9          | 7,291     | ゲオホールディングス        | 9.1          | 10,701  | 島忠              | 13.3         | 35,205    |
| TDCソフトウェアアジア         | 4.6          | 5,635     | ナガイレーベン           | 7.9          | 20,129    | アダストリア            | 9.1          | 27,937  | チヨダ             | 6.1          | 17,616    |
| ヤフー                  | 408.1        | 193,847   | 三菱食品              | 5.8          | 19,256    | くらコーポレーション        | 3.7          | 19,314  | ライフコーポレーション     | 6.2          | 13,881    |
| トレンドマイクロ             | 29.5         | 167,265   | 松田産業              | 4.8          | 7,056     | キャンドウ             | 4.3          | 7,318   | リンガーハット         | 4.9          | 16,691    |
| 日本オラクル               | 9.2          | 59,616    | 第一興商              | 9            | 47,340    | パルグループHLDGS       | 3.1          | 8,980   | AOKIホールディングス    | 9.8          | 14,415    |
| フューチャー               | 10.2         | 9,027     | メディパルHD           | 54.8         | 111,901   | エディオン             | 20.8         | 21,424  | オークワ            | 8            | 9,960     |
| CAC HOLDINGS         | 5.8          | 6,113     | 萩原電気              | 3.3          | 7,289     | サマーコーポレーション       | 7.8          | 5,631   | コメリ             | 8.5          | 23,791    |
| ソフトバンク・テクノ           | 4            | 8,288     | アズワン              | 3.8          | 19,912    | ワッツ               | 6.9          | 8,652   | 青山商事            | 10.7         | 42,639    |
| オービックビジネスC           | 2.9          | 16,559    | シモジマ              | 6.2          | 7,092     | ハローズ              | 2.1          | 5,006   | しまむら            | 6.5          | 92,300    |
| 伊藤忠テクノソリューション        | 12.6         | 49,140    | ドウシシャ             | 7            | 14,294    | あみやき亭             | 1.5          | 6,172   | 高島屋             | 91           | 104,377   |
| アイティフォー              | 12.7         | 7,924     | 小津産業              | 2.6          | 5,621     | ひらまつ              | 10.7         | 7,072   | 松屋              | 11.1         | 11,122    |
| 大塚商会                 | 14.9         | 101,469   | 黒田電気              | 7.4          | 16,102    | ゲンキー              | 2.6          | 7,826   | エチ・ツ・オーレリリング    | 25.8         | 51,729    |
| サイボウズ                | 12.5         | 6,350     | 丸文                | 1.7          | 1,276     | 大黒天物産             | 1.5          | 8,205   | 近鉄百貨店           | 21           | 7,497     |
| ソフトブレーン              | 10.1         | 5,282     | ハピネット             | 5.8          | 11,866    | ハニスホールディングス       | 6            | 7,350   | 丸井グループ          | 58.5         | 100,503   |
| 電通国際情報S              | 3.8          | 10,142    | 日本ライフライン          | 6.7          | 31,423    | アルペン              | 4.3          | 8,638   | アクシアリテイリング      | 3.3          | 14,223    |
| デジタルガレージ             | 11.3         | 22,645    | エクセル              | 3.4          | 4,926     | クオール              | 6.6          | 11,424  | イオン             | 226.9        | 389,360   |
| ウェザーニューズ             | 1.9          | 7,087     | マルカキカイ            | 3.5          | 6,632     | ジンス               | 3.9          | 24,219  | イズミ             | 10.3         | 65,714    |
| C I J                | 16.3         | 9,372     | I D O M           | 18.9         | 14,099    | ビックカメラ            | 31.3         | 36,057  | 平和堂             | 11.1         | 26,584    |
| WOWOW                | 3            | 9,630     | 進和                | 3.1          | 6,209     | DCMホールディングス       | 32.7         | 30,803  | フジ              | 6            | 16,974    |
| ネットワークシステムズ          | 30           | 32,820    | ネットワークス           | 4.1          | 17,507    | MonotaRO          | 20.4         | 76,194  | ヤオコー            | 6.1          | 29,829    |
| アルゴグラフィックス           | 6.1          | 16,360    | 伊藤忠               | 409.8        | 648,508   | アークランドサービスHD      | 2.6          | 10,868  | ゼビオホールディングス     | 6.1          | 11,260    |
| マーベラス                | 10.4         | 11,242    | 丸紅                | 546          | 377,013   | J. フロントリテイリング     | 69.4         | 115,689 | ケーズホールディングス     | 23.7         | 53,253    |
| イーベックス・グループHD        | 10.3         | 14,605    | 高島                | 33           | 6,897     | ドトール・日レスHD        | 9.5          | 22,268  | アインホールディングス     | 7            | 55,230    |
| 日本ユニシス               | 17.1         | 30,506    | 長瀬産業              | 28.4         | 45,951    | マツモトキヨシHLDGS      | 10.4         | 68,328  | 元氣寿司            | 3.2          | 7,145     |
| 兼松エレクトロニクス           | 3.8          | 12,787    | 蝶理                | 3.8          | 7,755     | ブロンコピラー           | 3.3          | 8,900   | ヤマダ電機           | 183.8        | 103,479   |
| 東京放送HD               | 33.3         | 62,271    | 豊田通商              | 60.7         | 202,738   | スタートトゥデイ          | 51           | 147,441 | アークランドサカモト      | 9.8          | 14,200    |
| 日本テレビHLDGS           | 49.5         | 90,783    | 兼松                | 116          | 25,056    | 物語コーポレーション        | 2            | 11,800  | ニトリホールディングス     | 24.1         | 404,880   |
| テレビ朝日HD              | 14.7         | 29,150    | 三井物産              | 501.4        | 763,381   | ココカラファイン          | 5.9          | 33,453  | 吉野家ホールディングス     | 2.8          | 41,172    |
| スカパー JASATHD         | 35           | 17,115    | 日本紙パルプ            | 28           | 11,676    | 三越伊勢丹HD           | 110.1        | 127,385 | 松屋フーズ           | 22.1         | 11,816    |
| テレビ東京HD              | 5            | 11,140    | 日立ハイテクノロジーズ       | 19.3         | 82,218    | ウエルシアHD           | 14.4         | 59,976  | サガミチェーン         | 8.5          | 11,942    |
| ワイヤレスゲート             | 4.5          | 6,961     | カメイ               | 6.1          | 8,985     | クリエイトS D H        | 7.8          | 20,732  | 関西スーパーマーケット     | 6            | 9,096     |
| コネクシオ                | 4.1          | 7,810     | OUGホールディングス       | 25           | 6,575     | 丸善 CHI HD         | 13           | 4,628   | 王将フードサービス       | 3.6          | 15,264    |
| 日本通信                 | 66.1         | 10,642    | スターゼン             | 2.4          | 11,880    | チムニー              | 2            | 5,656   | ブレナス            | 6            | 14,646    |
| 日本電信電話               | 443.4        | 2,351,350 | 山善                | 17.7         | 19,222    | ジョイフル本田           | 8.2          | 28,372  | ミニストップ          | 3.7          | 8,399     |
| K D D I              | 546.5        | 1,642,232 | 住友商事              | 348.5        | 493,824   | 鳥貴族               | 3            | 7,386   | アークス            | 10.3         | 24,812    |
| 光通信                  | 6.7          | 75,308    | 内田洋行              | 2.6          | 6,682     | すかいらーく            | 23.6         | 40,568  | パローホールディングス     | 12           | 29,988    |
| N T T ドコム            | 402.9        | 1,090,650 | 三菱商事              | 418.6        | 943,524   | 綿半ホールディングス        | 3.3          | 7,609   | ペルコ             | 2.5          | 14,000    |
| エムティアーアイ             | 9.6          | 6,412     | 第一実業              | 15           | 8,910     | イナイテッド・スーパーマケ     | 15.6         | 18,252  | 大庄              | 4.4          | 7,968     |
| GMO インターネット          | 21.9         | 31,119    | キャノンマーケティングJPN    | 15.6         | 37,440    | ブックオフコーポレーション     | 10.2         | 7,976   | ファーストリテイリング     | 9.3          | 341,310   |
| カドカワ                 | 17.7         | 24,868    | 西華産業              | 23           | 8,533     | あさひ               | 5.1          | 7,027   | サンドラッグ          | 21.3         | 92,761    |
| 学研ホールディングス           | 2.4          | 7,632     | 菱洋エレクトロ           | 4.3          | 7,559     | 日本調剤              | 2.1          | 7,633   | サックスパーホールディング   | 7            | 8,190     |
| ゼンリン                 | 8.4          | 21,840    | ユアサ商事             | 4            | 13,500    | コスモス薬品            | 2.8          | 65,688  | ペルナー            | 14.9         | 19,340    |

| 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      |              |  |  |
| <b>銀行業 (7.9%)</b> |         |           |                      | <b>証券・商品先物取引業 (1.1%)</b> |           |               |      | <b>サービス業 (4.0%)</b> |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| じもとホールディングス       | 48.6    | 9,622     | F P G                | 20.7                     | 20,203    | ファースト住建       | 2.9  | 4,582               | ナガワ            | 1.2     | 4,788   | よみうりランド      | 15   | 7,440   |              |  |  |
| めびきフィナンシャルG       | 264.2   | 110,964   | SBIホールディングス          | 60.6                     | 88,051    | トーセイ          | 9.3  | 7,467               | 東京都競馬          | 40      | 10,960  | 東京都市開発       | 34.2 | 39,398  |              |  |  |
| 東京TYフィナンシャルG      | 8.1     | 23,814    | ジャフコ                 | 9.2                      | 39,422    | エヌ・ティ・ティ都市開発  | 34.2 | 39,398              | 常盤興産           | 5.2     | 9,183   | エフ・ジェー・ネクスト  | 6.5  | 7,670   |              |  |  |
| 九州フィナンシャルG        | 90.5    | 62,173    | 大和証券G本社              | 498                      | 325,144   | サンフロンティア不動産   | 8    | 6,760               | カナモト           | 8.7     | 32,929  | エフ・ジェー・ネクスト  | 8    | 6,760   |              |  |  |
| ゆうちょ銀行            | 153     | 216,801   | 野村ホールディングス           | 1,132.6                  | 752,272   | グランディハウス      | 12   | 5,160               | 東京ドーム          | 23.1    | 23,885  | 日本空港ビルデング    | 17.6 | 77,968  |              |  |  |
| 富山第一銀行            | 15.8    | 8,026     | 岡三証券グループ             | 38                       | 25,992    | 日本空橋ビルデング     | 17.6 | 77,968              | 西尾レントオール       | 5.2     | 17,446  | サービス業 (4.0%) |      |         |              |  |  |
| コンソリア・フィナンシャル     | 359.9   | 194,597   | 丸三証券                 | 17.3                     | 15,275    | 日本工営          | 3.8  | 11,514              | トランス・コスモス      | 7       | 16,261  | 株式会社         |      |         |              |  |  |
| 西日本フィナンシャルHD      | 36.8    | 41,436    | 東洋証券                 | 29                       | 7,076     | L i f u l l   | 16.4 | 12,283              | 乃村工藝社          | 12.9    | 32,340  | 藤田観光         | 25   | 9,100   |              |  |  |
| 新生銀行              | 535     | 98,975    | 東海東京HD               | 61.1                     | 35,804    | ジェイエイ・リアルエム   | 4.3  | 7,310               | KNT-CTホールディングス | 39      | 5,967   | 日本管財         | 3.7  | 7,085   |              |  |  |
| あおぞら銀行            | 348     | 148,248   | 光世証券                 | 28                       | 4,396     | 日本M&Aセンター     | 17.2 | 73,100              | トーカイ           | 2.6     | 11,362  | セコム          | 59.9 | 512,025 |              |  |  |
| 三菱UFJフィナンシャルG     | 4,174.5 | 2,984,767 | 水戸証券                 | 26.7                     | 8,303     | タケエイ          | 7.4  | 7,962               | セントラル警備保障      | 3.2     | 6,460   | 丹青社          | 10.9 | 12,371  |              |  |  |
| りそなホールディングス       | 648.5   | 380,539   | いちよし証券               | 13                       | 11,778    | トラスト・テック      | 3.3  | 7,157               | メイテック          | 6.3     | 29,547  | アサツー・ディ・ケイ   | 8.5  | 24,072  |              |  |  |
| 三井住友トラストHD        | 115.1   | 439,221   | 松井証券                 | 29.1                     | 26,597    | パソナグループ       | 6.1  | 6,319               | 応用地質           | 6.3     | 9,500   | 船井総研ホールディング  | 7.9  | 20,840  |              |  |  |
| 三井住友フィナンシャルG      | 444     | 1,862,580 | マネックスG               | 59.7                     | 16,298    | C D S         | 8    | 11,032              | パネッセルホールディングス  | 19.7    | 80,474  | 学究社          | 3.9  | 6,013   |              |  |  |
| 第四銀行              | 54      | 28,188    | カブドットコム証券            | 23.2                     | 8,398     | リンクアンドモチベーション | 18.3 | 15,390              | イオンディライト       | 6       | 21,510  | ニチイ学館        | 13.6 | 15,055  |              |  |  |
| 北越銀行              | 6       | 15,846    | 極東証券                 | 7.3                      | 12,147    | G C A         | 7.5  | 7,162               | ダイセイキ          | 10.2    | 24,694  |              |      |         |              |  |  |
| 千葉銀行              | 212     | 167,692   | 岩井コスモホールディング         | 6.6                      | 8,078     | エス・エム・エス      | 8.6  | 27,262              | 株数             | 84,198  | 金額      | 129,347,079  |      |         |              |  |  |
| 群馬銀行              | 120.4   | 75,852    | 藍澤證券                 | 11.1                     | 7,514     | テナホールディングス    | 46   | 99,498              | 銘柄数<比率>        | 1,490銘柄 | <98.8%> |              |      |         |              |  |  |
| 武蔵野銀行             | 7.5     | 25,312    | マネーパートナーズGP          | 10.8                     | 5,324     | リニカル          | 4    | 7,092               |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 千葉興業銀行            | 18.4    | 10,451    | <b>保険業 (2.6%)</b>    |                          |           | クックパッド        | 14.7 | 12,891              |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 筑波銀行              | 28.6    | 9,352     | かんぽ生命保険              | 20.5                     | 49,569    | スタジオアリス       | 2.9  | 6,716               |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 七十七銀行             | 82      | 41,984    | SOMPOホールディングス        | 114.7                    | 494,930   | ジミックホールディングス  | 3.9  | 5,904               |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 青森銀行              | 44      | 17,336    | アニコムホールディングス         | 4.9                      | 11,260    | 総合警備保障        | 21.3 | 113,955             |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 秋田銀行              | 27      | 8,937     | M S & A D            | 163.3                    | 638,176   | カカココム         | 43.3 | 67,807              |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 山形銀行              | 30      | 14,820    | S O N Y F H          | 52.8                     | 95,462    | ルネサンス         | 4.7  | 9,259               |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 岩手銀行              | 3.4     | 14,977    | 第一生命HLDGS            | 335.4                    | 650,676   | ディップ          | 8    | 19,072              |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 東邦銀行              | 48      | 18,768    | 東京海上HD               | 221                      | 1,072,071 | オプトホールディング    | 8.6  | 12,048              |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 東北銀行              | 64      | 9,664     | T&Dホールディングス          | 202                      | 336,027   | 新日本科学         | 12   | 8,376               |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| みちのく銀行            | 58      | 10,614    | アドバンスクリエイト           | 3.5                      | 6,671     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| ぶくおフィナンシャルG       | 222     | 118,992   | <b>その他金融業 (1.3%)</b> |                          |           |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 静岡銀行              | 146     | 138,992   | 全国保証                 | 16.3                     | 77,506    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 十六銀行              | 62      | 21,328    | クレディセゾン              | 41.4                     | 91,908    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| スルガ銀行             | 56.9    | 150,955   | 芙蓉総合リース              | 6.3                      | 37,611    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 八十二銀行             | 103.1   | 69,901    | 興銀リース                | 10.5                     | 26,796    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 山梨中央銀行            | 32      | 14,336    | 東京センチュリー             | 10.8                     | 47,196    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 大垣共立銀行            | 85      | 27,370    | 日本証券金融               | 15.3                     | 8,705     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 福井銀行              | 50      | 13,850    | アイフル                 | 108.2                    | 40,791    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 北國銀行              | 56      | 23,856    | リコーリース               | 4.5                      | 15,907    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 清水銀行              | 2.4     | 8,628     | イオンフィナンシャルサービス       | 37                       | 84,397    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 滋賀銀行              | 49      | 28,567    | アコム                  | 117.5                    | 57,810    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 南都銀行              | 5.3     | 16,907    | ジャックス                | 32                       | 16,768    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 百五銀行              | 47      | 21,338    | オリコ                  | 127.8                    | 24,537    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 京都銀行              | 98      | 101,528   | 日立キャピタル              | 13.1                     | 34,793    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 紀陽銀行              | 18      | 34,452    | オリックス                | 393                      | 687,946   |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 三重銀行              | 3.3     | 7,989     | 三菱UFJリース             | 141.2                    | 80,766    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| ほくほくフィナンシャルG      | 35.7    | 60,368    | 日本取引所グループ            | 171.8                    | 340,335   |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 広島銀行              | 160     | 74,560    | イー・ギランティ             | 2.7                      | 7,333     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 山陰合同銀行            | 31.1    | 27,896    | NECキャピタルソリューション      | 2.9                      | 5,037     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 中国銀行              | 38.1    | 60,579    | <b>不動産業 (2.5%)</b>   |                          |           |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 鳥取銀行              | 4.2     | 7,085     | いちご                  | 58.7                     | 19,488    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 伊予銀行              | 73.6    | 63,664    | 日本駐車場開発              | 71.1                     | 11,020    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 百十四銀行             | 59      | 21,181    | ヒューリック               | 115.7                    | 126,807   |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 四国銀行              | 40      | 12,400    | 野村不動産HLDGS           | 40                       | 96,400    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 阿波銀行              | 45      | 34,515    | 三重交通グループHD           | 11.9                     | 4,641     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 大分銀行              | 33      | 14,157    | サムティ                 | 5.6                      | 6,776     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 宮崎銀行              | 38      | 13,946    | 日本商業開発               | 3.9                      | 6,341     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 佐賀銀行              | 30      | 8,040     | プラススコソリューション         | 9.3                      | 13,261    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 十八銀行              | 27      | 8,667     | ユニホールディングス           | 5.3                      | 15,359    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 沖縄銀行              | 4.9     | 21,339    | 日本管理センター             | 4.6                      | 6,196     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 琉球銀行              | 11.2    | 16,979    | フージャースHD             | 13                       | 13,559    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| セブン銀行             | 221     | 92,157    | オープンハウス              | 8.3                      | 27,888    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| みずほフィナンシャルG       | 7,516.2 | 1,479,939 | 東急不動産HD              | 130.6                    | 89,852    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 高知銀行              | 68      | 8,704     | 飯田GH D               | 46.1                     | 84,409    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 山口フィナンシャルG        | 49      | 64,386    | パーク24                | 28.7                     | 81,536    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 長野銀行              | 3.2     | 6,281     | バラカ                  | 2.7                      | 5,443     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 名古屋銀行             | 2.8     | 11,620    | 三井不動産                | 295.6                    | 795,016   |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 北洋銀行              | 86.1    | 33,234    | 三菱地所                 | 415                      | 890,175   |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 愛知銀行              | 1.9     | 12,084    | 平和不動産                | 10.7                     | 19,559    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 第三銀行              | 4.2     | 7,064     | 東京建物                 | 63.9                     | 98,725    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 中京銀行              | 2.7     | 6,118     | ダイビル                 | 13.9                     | 16,304    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 大光銀行              | 30      | 7,110     | 京阪神ビルディング            | 11.5                     | 7,751     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 愛媛銀行              | 6.4     | 8,940     | 住友不動産                | 135                      | 471,555   |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| トマト銀行             | 5       | 7,770     | 大京                   | 102                      | 23,868    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| みなと銀行             | 5.1     | 10,684    | テーオーシー               | 21.3                     | 22,940    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 京葉銀行              | 36      | 17,136    | 東京楽天地                | 3                        | 1,695     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 関西アーバン銀行          | 8.3     | 10,673    | レオパレス21              | 69.3                     | 46,569    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 栃木銀行              | 29.1    | 13,822    | スタートコーポレーション         | 6.5                      | 17,524    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 北日本銀行             | 2.4     | 7,548     | フジ住宅                 | 5.1                      | 3,692     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 東和銀行              | 116     | 14,848    | 空港施設                 | 9.2                      | 5,437     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 福島銀行              | 92      | 8,004     | ゴールドクレスト             | 5.2                      | 12,396    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 大東銀行              | 45      | 7,470     | 日神不動産                | 8.9                      | 5,340     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| トモニホールディングス       | 35.9    | 19,996    | タカラレーベン              | 25.2                     | 12,978    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| フィデアホール           | 65.9    | 12,059    | サンヨーハウジング名古屋         | 5.5                      | 5,902     |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |
| 池田泉州HD            | 55.7    | 25,566    | イオンモール               | 35.4                     | 78,942    |               |      |                     |                |         |         |              |      |         |              |  |  |

合計 銘柄数 <比率> 1,490銘柄 <98.8%>

(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    | 1,507        | —   |
| TOPIX | —            | —   |

(注) 単位未満は切捨て。

**■有価証券の貸付及び借入状況**

| 区分 | 2017年6月15日現在        |        |
|----|---------------------|--------|
|    | 貸付                  | 借入     |
| 株式 | 6,225,500 (868,800) | 株一 (一) |

(注1) ( )内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。  
 (注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券へ868,800株を貸付しています。

## トピックス・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第28期 (決算日 2016年9月20日)

(計算期間 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。<br>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。<br>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。<br>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  |

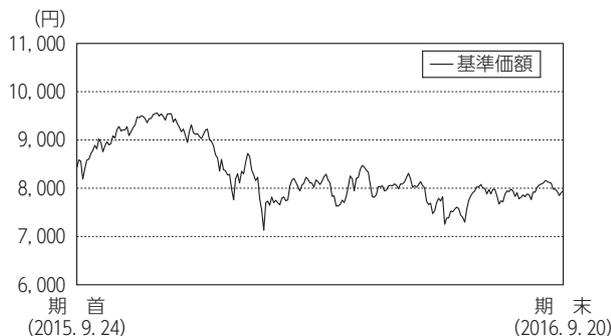
## 大和投資信託

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<br>(株式) | 0円<br>(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<br>8,579.9<br>(△3,532.419) | 千円<br>8,281,785<br>(—) | 千株<br>4,031.28 | 千円<br>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 | 鉱業 (0.3%) | 日鉄鉱業 | 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 | ヤクルト | 33.9 | 35.3 | 167,498 | 建設業 (3.1%) | ショールドHD | 6 | 6.8 | 31,042 | ヤマダ・エスバイエルホーム | 52 | — | — | 明治ホールディングス | 18.7 | 39.4 | 376,664 | シャープ | 20.7 | 20.4 | 17,748 | バココーポレーション | 14.7 | — | — | 雪印メグミルク | 15.4 | 15.7 | 54,243 | 三菱 | 44.4 | 44.7 | 27,267 | パナホーム | 25 | 25 | 19,600 | ブリマハム | 41 | 46 | 16,376 | 安藤・間 | 23.9 | 22 | 21,538 | 大和ハウス | 186.9 | 193 | 513,283 | 日本ハム | 47 | 47 | 113,975 | 東急建設 | 28.5 | 27.1 | 49,836 | ライト工業 | 11.2 | 13.4 | 15,624 | 伊藤ハム | 36 | — | — | コムシホールディングス | 9.5 | 8.9 | 6,764 | 積水ハウス | 199 | 217.3 | 363,434 | 丸大食品 | 37 | 36 | 17,280 | ミサワホーム | 5.3 | 4.8 | 11,092 | 日特建設 | 11.2 | 18.6 | 8,872 | 米久 | 1.4 | — | — | 高松コンストラクショングループ | 2.7 | 2.8 | 20,888 | ユアテック | 12 | 12 | 6,360 | S Foods | 4.9 | 4.6 | 12,084 | 東建コーポレーション | 328 | 340 | 258,400 | 中電工 | 9.7 | 7.5 | 14,865 | 伊藤ハム米久HLDGS | — | 41.9 | 42,360 | 大成建設 | 190 | 196 | 193,256 | 関電工 | 29 | 26 | 23,842 | サッポロホールディングス | 108 | 20.2 | 55,388 | 大林組 | 193 | 199 | 177,110 | ぎんでん | 40.7 | 35.1 | 39,768 | アサヒグループホールディングス | 118.9 | 122.7 | 436,443 | 清水建設 | 46.7 | 62 | 10,726 | 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 | 256.4 | 281 | 457,889 | 飛鳥建設 | 79.8 | 76.8 | 71,961 | トーエネック | 12 | 11 | 5,225 | キリンHD | 51.9 | 47.3 | 44,083 | 長谷工コーポレーション | 11 | 10.3 | 11,433 | 住友電設 | 6.1 | 6 | 6,210 | 宝ホールディングス | 51.9 | 47.3 | 44,083 | 松井建設 | 7 | 18 | 6,246 | 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 | 銭高組 | 277 | 306 | 213,588 | 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 | 鹿島建設 | 52.8 | 51.3 | 8,669 | 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 | 不動テトラ | 42 | 43 | 13,416 | 三機工業 | 13.9 | 14.3 | 11,954 | ココ・コーライーストジャパン | 42.8 | 45.5 | 192,010 | 鉄建建設 | 70 | 75 | 34,350 | 日揮 | 64 | 65 | 109,785 | サントリー食品インター | 3.2 | 3.4 | 18,564 | 西松建設 | 264 | 255.1 | 24,744 | 日揮 | 28 | 34 | 6,766 | ダイドードリンコ | 18.4 | 19.3 | 65,330 | 三井住友建設 | 19 | 27 | 14,553 | 中外炉工業 | 10 | 10 | 9,590 | キーコーヒー | 6.4 | 6.7 | 12,750 | 大豊建設 | 43 | 40 | 33,360 | 太平電業 | 17.7 | 18.6 | 27,583 | 日清オイリオグループ | 35 | 36 | 16,488 | 前田建設 | 3.5 | 15.2 | 5,973 | 高砂熱学 | 14 | 13.9 | 6,463 | 不二製油グループ | 17.1 | 17.5 | 34,790 | ナカノフード建設 | 60 | 58 | 32,422 | 明星工業 | 10.1 | 9.9 | 15,780 | J-オイルミルズ | 33 | 32 | 11,296 | 興村組 | 8.1 | 8 | 22,392 | 大気社 | 9.5 | 7.4 | 18,352 | キッコーマン | 52 | 49 | 156,800 | 東鉄工業 | 17 | 37 | 7,992 | ダイダ | 11 | 10 | 7,830 | 味の素 | 146 | 138.1 | 307,134 | 浅沼組 | 80 | 76 | 39,140 | 日比谷総合設備 | 9 | 8.6 | 14,052 | キューピー | 32 | 33.9 | 102,039 | 戸田建設 | 83 | 97 | 25,608 | 東芝プラントシステム | 10.1 | 9.9 | 15,780 | ハウス食品G本社 | 23.1 | 21.9 | 49,187 | 熊谷組 | 20 | 33 | 8,415 | 東洋エンジニア | 33 | 35 | 10,885 | カゴメ | 21 | 23.1 | 57,495 | 北野建設 | 16 | 13 | 5,954 | 千代田化工建 | 46 | 47 | 37,506 | アリアケジャパン | 6.1 | 5.6 | 29,400 | 三井ホーム | 10.7 | 10.1 | 9,059 | 新興プランテック | 14.4 | 13.5 | 9,517 | ニチレイ | 71 | 71 | 75,331 | 矢作建設 | — | 20.3 | 7,064 | 食料品 (4.9%) | 日本製粉 | 39 | 43 | 32,379 | 東洋水産 | 32.6 | 31.5 | 136,552 | ピーエス三菱 | 14.1 | 27.2 | 10,390 | 日本製粉 | 70 | 71 | 107,352 | 日清食品HD | 26.5 | 27.2 | 165,376 | 日本ハウスHLDGS | 23.3 | 24.4 | 390,278 | 日清製粉G本社 | 30 | 27 | 13,986 | 永谷園ホールディングス | 8 | 8 | 10,080 | 大東建託 | 4.7 | 10.7 | 9,416 | 昭和産業 | 4.8 | 8.5 | 6,069 | 一正蒲鉾 | 0.4 | — | — | 新日本建設 | 14 | 15 | 28,605 | フィード・ワン | 61.9 | 54.7 | 6,235 | フジッコ | 7 | 6.9 | 14,959 | NIPPPO | 16 | 27 | 6,831 | 日本甜菜糖 | 49 | 49 | 9,408 | ロックフィールド | 4.2 | 8.4 | 11,944 | 東亜道路 | — | — | — | 三井製糖 | 29 | 28 | 13,020 | 日本たばこ産業 | 375.6 | 361.7 | 1,434,502 | 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 |

| 銘柄                  | 期首   |      |         | 当期末            |       |       | 銘柄      | 期首                     |       |       | 当期末     |                        |       | 銘柄    | 期首      |                        |       | 当期末   |         |                        |       |       |         |
|---------------------|------|------|---------|----------------|-------|-------|---------|------------------------|-------|-------|---------|------------------------|-------|-------|---------|------------------------|-------|-------|---------|------------------------|-------|-------|---------|
|                     | 株数   | 株数   | 評価額     | 株数             | 株数    | 評価額   |         | 株数                     | 株数    | 評価額   | 株数      | 株数                     | 評価額   |       | 株数      | 株数                     | 評価額   | 株数    | 株数      | 評価額                    |       |       |         |
|                     | 千株   | 千株   | 千円      |                | 千株    | 千株    |         | 千株                     | 千株    | 千円    |         |
| ミヨシ油脂               | 48   | 95   | 11,875  | タキロン           | 17    | 17    | 7,667   | 日医工                    | 14.3  | 14.6  | 26,864  |
| <b>繊維製品 (0.8%)</b>  |      |      |         | 旭有機材           | 30    | 32    | 6,016   | キッセイ薬品工業               | 10.8  | 10.1  | 26,047  |
| 片倉工業                | 9.2  | 8.9  | 10,306  | 日立化成           | 28.7  | 29.5  | 67,378  | 生化学工業                  | 12.1  | 12.4  | 19,120  |
| グンゼ                 | 50   | 49   | 15,337  | ニチバン           | —     | 9     | 6,669   | 栄研化学                   | 5.8   | 6     | 16,692  |
| 東洋紡                 | 253  | 244  | 40,016  | リケンテクノス        | 12.4  | 13.5  | 6,466   | 鳥居薬品                   | 4.5   | 4.7   | 9,479   |
| ユニチカ                | 235  | 233  | 13,048  | 大倉工業           | 21    | 20    | 7,180   | J C R ファーマ             | 5.2   | 5.4   | 13,597  | J C R ファーマ             | 5.2   | 5.4   | 13,597  | J C R ファーマ             | 5.2   | 5.4   | 13,597  | J C R ファーマ             | 5.2   | 5.4   | 13,597  |
| 富士紡ホールディングス         | 36   | 37   | 10,508  | 積水化成           | 21    | 18    | 6,210   | 東和薬品                   | 3.3   | 3     | 12,420  |
| 日清紡ホールディングス         | 40   | —    | —       | 群栄化学           | 19    | 21    | 6,174   | 富士製薬工業                 | 1     | 2.7   | 6,901   |
| 倉敷紡績                | 72   | 58   | 10,556  | ダイキョーニシカワ      | 1.7   | 8.6   | 10,397  | 沢井製薬                   | 9.4   | 10.4  | 72,488  |
| シキボウ                | 69   | 121  | 13,068  | 日本化薬           | 39    | 40    | 42,480  | ゼリア新薬工業                | 12.7  | 13.1  | 21,064  |
| 日本毛織                | 20   | 18.6 | 12,982  | カーリットホールディングス  | —     | 10.2  | 4,967   | 第一三共                   | 199.3 | 205.9 | 497,557 |
| ダイドーリミテッド           | 15.6 | 14.7 | 6,012   | 日本精工           | 8.2   | 7.9   | 5,988   | キョーリン製薬HD              | 15.9  | 16.1  | 35,307  |
| 帝国繊維                | 7.3  | 7    | 9,660   | A D E K A      | 26.6  | 27.8  | 38,058  | 大幸薬品                   | 3.1   | 4.6   | 7,162   |
| 帝人                  | 246  | 248  | 97,712  | 日油             | 48    | 46    | 45,034  | ダイト                    | 3.5   | 3.9   | 8,521   |
| 東レ                  | 456  | 439  | 422,625 | 花王             | 159.6 | 155   | 877,300 | 大塚ホールディングス             | 126.9 | 131.7 | 596,074 |
| サカイ オーベックス          | —    | 58   | 11,136  | 第一工業製薬         | 16    | 25    | 8,275   | 大正製薬HD                 | 14.1  | 14.5  | 146,595 |
| 住江織物                | 24   | 37   | 8,251   | 三洋化成           | 20    | 20    | 16,920  | ペプチドリム                 | —     | 10.3  | 50,624  |
| 日本バイリーン             | 13   | —    | —       | 大日本塗料          | 46    | 43    | 8,600   | <b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>  |       |       |         |
| 芦森工業                | —    | 47   | 7,050   | 日本ペイント HOLD    | 51.1  | 47.2  | 158,356 | 日本コークス工業               | 81.3  | 64.2  | 5,200   |
| アツギ                 | 90   | 89   | 9,434   | 関西ペイント         | 71    | 67.9  | 146,799 | 昭和シエル石油                | 58.3  | 57.8  | 51,268  |
| セーレン                | 17   | 16.1 | 18,756  | 中国塗料           | 18    | 18    | 12,888  | コスモ石油                  | 169   | —     | —       |
| 小松精練                | 15.7 | 13.2 | 8,448   | 日本特殊塗料         | 2.8   | 6.2   | 6,925   | ニチレキ                   | 9     | 9     | 6,354   |
| ワコールホールディングス        | 34   | 33   | 36,399  | 藤倉化成           | 13.1  | 14.5  | 8,482   | 東燃ゼネラル石油               | 88    | 90    | 86,310  |
| ホギメディカル             | 3.8  | 3.8  | 27,398  | 太陽ホールディングス     | 5.1   | 4.6   | 15,755  | ユシロ化学                  | 4.8   | 4.8   | 6,710   |
| T S I ホールディングス      | 28.2 | 27.6 | 15,538  | D I C          | 236   | 23.7  | 73,233  | ビービー・カストロール            | —     | 4.3   | 5,396   |
| 三陽商会                | 39   | 37   | 5,883   | サカタインクス        | 13.5  | 12.9  | 14,976  | 富士石油                   | 17.9  | 19.5  | 5,889   |
| オンワードホールディングス       | 42   | 36   | 24,732  | 東洋インキSCホールディング | 58    | 57    | 25,479  | 出光興産                   | 28.1  | 31.2  | 61,869  |
| ゴールドウイン             | 16   | 2.8  | 14,700  | T & K T O K A  | 2.7   | 6.2   | 5,604   | J X ホールディングス           | 650.2 | 712.9 | 280,098 | J X ホールディングス           | 650.2 | 712.9 | 280,098 | J X ホールディングス           | 650.2 | 712.9 | 280,098 | J X ホールディングス           | 650.2 | 712.9 | 280,098 |
| デサント                | 14.9 | 14.4 | 17,668  | 富士フイルム HLDGS   | 135.5 | 139   | 529,868 | コスモエネルギーHLDGS          | —     | 18.6  | 21,948  |
| <b>パルプ・紙 (0.3%)</b> |      |      |         | 資生堂            | 105.3 | 116.9 | 315,337 | <b>ゴム製品 (0.9%)</b>     |       |       |         |
| 特殊東海製紙              | 40   | 38   | 12,692  | ライオン           | 69    | 71    | 104,157 | 横浜ゴム                   | 34.8  | 36.4  | 59,441  |
| 王子ホールディングス          | 243  | 229  | 92,516  | 高砂香料           | 22    | 4.3   | 11,373  | 東洋ゴム                   | 27.5  | 27.5  | 37,345  |
| 日本製紙                | 29.4 | 31.2 | 57,876  | マンダム           | 6.3   | 5.8   | 25,520  | ブリヂストン                 | 199.9 | 206.1 | 747,730 |
| 三菱製紙                | 121  | 111  | 7,548   | ミルボン           | 4.1   | 3.9   | 18,252  | 住友ゴム                   | 52.6  | 55.8  | 86,322  |
| 北越紀州製紙              | 40.6 | 39.5 | 24,608  | ファンケル          | 14.4  | 14.2  | 24,750  | 藤倉ゴム                   | 6.7   | —     | —       |
| 中越パルプ               | 28   | 30   | 6,750   | コーサー           | 9.7   | 9.9   | 97,812  | オカモト                   | 25    | 20    | 24,280  |
| 大王製紙                | 27   | 27.2 | 32,504  | シーズ・ホールディングス   | 8.8   | 8.4   | 22,680  | ニッタ                    | 6.4   | 5.9   | 13,764  |
| レンゴウ                | 52   | 53   | 33,125  | ポーラ・オルビスHD     | 6.1   | 6.2   | 54,932  | 住友理工                   | 11.3  | 13.3  | 12,701  |
| トーモク                | 27   | 24   | 6,600   | ノビアホールディングス    | 4.4   | 4.1   | 12,976  | 三ツ星ベルト                 | 17    | 16    | 13,040  |
| ザ・パック               | 4.9  | 4.7  | 12,064  | エステー           | 3.8   | —     | —       | バンドー化学                 | 25    | 25    | 11,700  |
| <b>化学 (6.4%)</b>    |      |      |         | コニシ            | 5.1   | 10.6  | 12,349  | <b>ガラス・土石製品 (0.9%)</b> |       |       |         |
| クラレ                 | 92.4 | 94.8 | 134,900 | 長谷川香料          | 7.6   | 7.9   | 14,646  | 日東紡績                   | 48    | 43    | 14,061  |
| 旭化成                 | 369  | 378  | 302,173 | 星光PMC          | 2.1   | 5.6   | 6,406   | 旭硝子                    | 311   | 301   | 194,446 |
| 共和レザー               | —    | 6.3  | 4,794   | 小林製薬           | 9.6   | 18.2  | 93,548  | 日本板硝子                  | 306   | 315   | 25,830  |
| 昭和電工                | 410  | 40.8 | 51,122  | 荒川化学工業         | 6.7   | 6.2   | 7,440   | 日本山村硝子                 | 35    | 30    | 5,130   |
| 住友化学                | 435  | 445  | 203,810 | メック            | 6.3   | —     | —       | 日本電気硝子                 | 119   | 123   | 63,714  |
| 住友精化                | 14   | 14   | 9,506   | 日本高純度化学        | 3.5   | 3.1   | 7,012   | 住友大阪セメント               | 115   | 123   | 56,826  |
| 日産化学                | 39   | 36.7 | 113,586 | タカラバイオ         | —     | 12.2  | 20,056  | 太平洋セメント                | 373   | 379   | 110,668 |
| ラサ工業                | —    | 41   | 4,264   | J C U          | 1.9   | 2.3   | 8,441   | 日本ヒューム                 | 8.5   | 8.1   | 5,094   |

トピックス・インデックス・マザーファンド

| 銘柄                 | 期首    |       |         | 当期末   |       |         | 銘柄           | 期首    |       |         | 当期末   |       |         | 銘柄           | 期首    |       |           | 当期末   |       |           |
|--------------------|-------|-------|---------|-------|-------|---------|--------------|-------|-------|---------|-------|-------|---------|--------------|-------|-------|-----------|-------|-------|-----------|
|                    | 株数    | 千株    | 千円      | 株数    | 千株    | 千円      |              | 株数    | 千株    | 千円      | 株数    | 千株    | 千円      |              | 株数    | 千株    | 千円        | 株数    | 千株    | 千円        |
| 三井金属               | 170   | 161   | 33,327  | 170   | 161   | 33,327  | アイチコーポレーション  | 11.6  | 10    | 7,090   | 11.6  | 10    | 7,090   | ジーエス・ユアサコーポ  | 113   | 114   | 47,196    | 113   | 114   | 47,196    |
| 東邦亜鉛               | 39    | 43    | 13,459  | 39    | 43    | 13,459  | 小森コーポレーション   | 15.3  | 15.2  | 19,273  | 15.3  | 15.2  | 19,273  | サクサホールディングス  | 9     | —     | —         | 9     | —     | —         |
| 三菱マテリアル            | 370   | 378   | 107,352 | 370   | 378   | 107,352 | 鶴見製作所        | 5.3   | 5.1   | 7,507   | 5.3   | 5.1   | 7,507   | メルコホールディングス  | 4     | 4.2   | 10,802    | 4     | 4.2   | 10,802    |
| 住友鉱山               | 163   | 167   | 217,100 | 163   | 167   | 217,100 | 住友精密         | 14    | 21    | 6,552   | 14    | 21    | 6,552   | 日本電気         | 729   | 797   | 204,829   | 729   | 797   | 204,829   |
| DOWAホールディングス       | 71    | 80    | 54,960  | 71    | 80    | 54,960  | 荏原製作所        | 124   | 135   | 74,790  | 124   | 135   | 74,790  | 富士通          | 544   | 560   | 300,272   | 544   | 560   | 300,272   |
| 古河機金               | 105   | 103   | 16,171  | 105   | 103   | 16,171  | 西島製作所        | 7.7   | 7.7   | 7,915   | 7.7   | 7.7   | 7,915   | 沖電気          | 209   | 260   | 35,880    | 209   | 260   | 35,880    |
| 大阪チタニウム            | 6.2   | 6.8   | 9,370   | 6.2   | 6.8   | 9,370   | 北越工業         | 5.9   | 14.3  | 9,295   | 5.9   | 14.3  | 9,295   | 電気興業         | 20    | 19    | 9,443     | 20    | 19    | 9,443     |
| 東邦チタニウム            | 10.9  | 11.9  | 8,663   | 10.9  | 11.9  | 8,663   | ダイキン工業       | 82.4  | 85    | 796,280 | 82.4  | 85    | 796,280 | サンケン電気       | 31    | 36    | 11,412    | 31    | 36    | 11,412    |
| UACJ               | 70    | 88    | 25,520  | 70    | 88    | 25,520  | オルガノ         | 15    | 14    | 5,670   | 15    | 14    | 5,670   | アイホン         | 4.4   | 4.1   | 6,535     | 4.4   | 4.1   | 6,535     |
| 古河電工               | 185   | 194   | 50,052  | 185   | 194   | 50,052  | トーヨーカネツ      | 42    | 42    | 8,526   | 42    | 42    | 8,526   | ルネサスエレクトロニクス | 28.9  | 33    | 20,427    | 28.9  | 33    | 20,427    |
| 住友電工               | 222.7 | 241.1 | 347,063 | 222.7 | 241.1 | 347,063 | 栗田工業         | 32.3  | 35.2  | 80,537  | 32.3  | 35.2  | 80,537  | セイコーエプソン     | 76.5  | 86.2  | 163,780   | 76.5  | 86.2  | 163,780   |
| フジクラ               | 86    | 84    | 46,872  | 86    | 84    | 46,872  | 椿本チエイン       | 31    | 34    | 26,146  | 31    | 34    | 26,146  | ワコム          | 48    | 48.4  | 15,052    | 48    | 48.4  | 15,052    |
| 昭和電線HLDGS          | 85    | 98    | 6,664   | 85    | 98    | 6,664   | 日本コンベヤ       | 25    | —     | —       | 25    | —     | —       | アルバック        | 9.9   | 10.9  | 31,588    | 9.9   | 10.9  | 31,588    |
| タツタ電線              | 12.6  | 16.7  | 5,794   | 12.6  | 16.7  | 5,794   | アネスト岩田       | 12.2  | 11.6  | 11,565  | 12.2  | 11.6  | 11,565  | アクセル         | 4.5   | 4.9   | 3,547     | 4.5   | 4.9   | 3,547     |
| リョービ               | 39    | 39    | 16,965  | 39    | 39    | 16,965  | ダイフク         | 28.8  | 31.2  | 54,350  | 28.8  | 31.2  | 54,350  | EIZO         | 5.7   | 6.1   | 16,012    | 5.7   | 6.1   | 16,012    |
| アールステイ             | 7.5   | 9.4   | 9,672   | 7.5   | 9.4   | 9,672   | 加藤製作所        | 14    | 21    | 8,610   | 14    | 21    | 8,610   | ジャパンディスプレイ   | 114.7 | 110.1 | 18,276    | 114.7 | 110.1 | 18,276    |
| アサヒHD              | 9.6   | 9.4   | 16,384  | 9.6   | 9.4   | 16,384  | 油研工業         | —     | 54    | 9,072   | —     | 54    | 9,072   | 日本信号         | 16.1  | 16.6  | 13,612    | 16.1  | 16.6  | 13,612    |
| <b>金属製品 (0.6%)</b> |       |       |         |       |       |         | タダノ          | 28    | 28    | 25,648  | 28    | 28    | 25,648  | 京三製作所        | 17    | 19    | 7,011     | 17    | 19    | 7,011     |
| 稲葉製作所              | 1.5   | 4.5   | 5,530   | 1.5   | 4.5   | 5,530   | フジテック        | 17.2  | 17    | 19,329  | 17.2  | 17    | 19,329  | 能美防災         | 8     | 7.1   | 10,224    | 8     | 7.1   | 10,224    |
| 宮地エンジニアリング         | 11    | 56    | 7,952   | 11    | 56    | 7,952   | CKD          | 16.8  | 17.3  | 20,344  | 16.8  | 17.3  | 20,344  | ホーチキ         | 2.6   | 5.6   | 5,964     | 2.6   | 5.6   | 5,964     |
| トーカロ               | 4.6   | 5.3   | 11,803  | 4.6   | 5.3   | 11,803  | キトー          | 7.8   | 9.3   | 8,332   | 7.8   | 9.3   | 8,332   | エレコム         | 2.5   | 5.9   | 12,443    | 2.5   | 5.9   | 12,443    |
| SUMCO              | 45.7  | 48.8  | 40,162  | 45.7  | 48.8  | 40,162  | 平和           | 18.5  | 18    | 41,202  | 18.5  | 18    | 41,202  | 日本無線         | 16    | 21    | 5,649     | 16    | 21    | 5,649     |
| 川田テクノロジー           | 1.5   | 1.5   | 6,675   | 1.5   | 1.5   | 6,675   | 理想科学工業       | 7.5   | 6.7   | 10,867  | 7.5   | 6.7   | 10,867  | パナソニック       | 693.6 | 666.3 | 678,293   | 693.6 | 666.3 | 678,293   |
| 東洋製罐グループHD         | 42.3  | 41.1  | 75,624  | 42.3  | 41.1  | 75,624  | SANKYO       | 15.5  | 15.3  | 53,091  | 15.5  | 15.3  | 53,091  | シャープ         | 479   | —     | —         | 479   | —     | —         |
| ホクサンホールディングス       | 24    | 20    | 6,860   | 24    | 20    | 6,860   | 日本金銭機械       | 6.1   | 6.7   | 9,279   | 6.1   | 6.7   | 9,279   | アンリツ         | 34    | 34.6  | 19,583    | 34    | 34.6  | 19,583    |
| 横河ブリッジHLDGS        | 12.3  | 12.4  | 13,416  | 12.3  | 12.4  | 13,416  | マースエンジニアリング  | 4.7   | 3.9   | 7,683   | 4.7   | 3.9   | 7,683   | 富士通ゼネラル      | 18    | 18    | 36,954    | 18    | 18    | 36,954    |
| 三和ホールディングス         | 57.1  | 61.4  | 58,084  | 57.1  | 61.4  | 58,084  | 福島工業         | 3.9   | 4.2   | 13,398  | 3.9   | 4.2   | 13,398  | 日立国際電気       | 16    | 14    | 25,494    | 16    | 14    | 25,494    |
| 文化シヤッター            | 19    | 18.2  | 13,650  | 19    | 18.2  | 13,650  | ダイコク電機       | 3.5   | 3.4   | 5,168   | 3.5   | 3.4   | 5,168   | ソニー          | 397.6 | 412.5 | 1,369,500 | 397.6 | 412.5 | 1,369,500 |
| 三協立山               | 8.4   | 8.3   | 13,097  | 8.4   | 8.3   | 13,097  | 竹内製作所        | 6.3   | 12.2  | 17,019  | 6.3   | 12.2  | 17,019  | TDK          | 34.1  | 34.9  | 251,629   | 34.1  | 34.9  | 251,629   |
| アルインコ              | —     | 6.8   | 6,120   | —     | 6.8   | 6,120   | アマノ          | 19.8  | 18    | 28,404  | 19.8  | 18    | 28,404  | 帝国通信工業       | —     | 46    | 6,854     | —     | 46    | 6,854     |
| LIXILグループ          | 87.1  | 83.2  | 180,211 | 87.1  | 83.2  | 180,211 | JUKI         | 9.4   | 10.4  | 7,280   | 9.4   | 10.4  | 7,280   | ミツミ電機        | 22    | 24.9  | 14,367    | 22    | 24.9  | 14,367    |
| ノーリツ               | 11.8  | 11.8  | 24,083  | 11.8  | 11.8  | 24,083  | サンデンホールディングス | 38    | 37    | 10,767  | 38    | 37    | 10,767  | タムラ製作所       | 26    | 27    | 10,098    | 26    | 27    | 10,098    |
| 長府製作所              | 6.5   | 5.9   | 15,198  | 6.5   | 5.9   | 15,198  | 蛇の目マシン       | 67    | 12    | 6,552   | 67    | 12    | 6,552   | アルプス電気       | 46    | 50.7  | 124,975   | 46    | 50.7  | 124,975   |
| リンナイ               | 10.9  | 11.2  | 102,256 | 10.9  | 11.2  | 102,256 | マックス         | 10    | 10    | 11,540  | 10    | 10    | 11,540  | パイオニア        | 92.4  | 97.4  | 21,622    | 92.4  | 97.4  | 21,622    |
| 岡部                 | 13.2  | 13.7  | 11,343  | 13.2  | 13.7  | 11,343  | グローリー        | 18.1  | 19.7  | 64,616  | 18.1  | 19.7  | 64,616  | 日本電波工業       | 7.7   | 8.1   | 6,650     | 7.7   | 8.1   | 6,650     |
| ジーテクト              | 4     | 7.3   | 13,329  | 4     | 7.3   | 13,329  | 新晃工業         | 5.3   | 5.3   | 6,799   | 5.3   | 5.3   | 6,799   | 日本トリム        | 1.1   | 1.9   | 10,944    | 1.1   | 1.9   | 10,944    |
| 東プレ                | 12.4  | 12.2  | 24,766  | 12.4  | 12.2  | 24,766  | 大和冷機工業       | 9.9   | 10.8  | 9,622   | 9.9   | 10.8  | 9,622   | ローランドディー・ジー  | 2.8   | 3.6   | 8,154     | 2.8   | 3.6   | 8,154     |
| 高周波熱錬              | 12.4  | 12.8  | 9,241   | 12.4  | 12.8  | 9,241   | セガミーホールディングス | 60.8  | 60.9  | 86,782  | 60.8  | 60.9  | 86,782  | フオスター電機      | 6.4   | 7.7   | 14,753    | 6.4   | 7.7   | 14,753    |
| 東京製鋼               | 50    | 49    | 7,938   | 50    | 49    | 7,938   | 日本ピストンリング    | 34    | 7.5   | 11,227  | 34    | 7.5   | 11,227  | クラリオン        | 34    | 34    | 10,234    | 34    | 34    | 10,234    |
| パイオラックス            | 3.4   | 3.3   | 19,833  | 3.4   | 3.3   | 19,833  | リケン          | 30    | 31    | 10,416  | 30    | 31    | 10,416  | SMK          | 20    | 22    | 7,370     | 20    | 22    | 7,370     |
| 日本発条               | 51.5  | 53.3  | 51,381  | 51.5  | 53.3  | 51,381  | TPR          | 7     | 7.5   | 20,655  | 7     | 7.5   | 20,655  | ヨコオ          | —     | 8.1   | 4,900     | —     | 8.1   | 4,900     |
| 三益半導体              | 6.5   | 5.5   | 6,319   | 6.5   | 5.5   | 6,319   | ホシザキ         | 12.3  | 12.9  | 112,746 | 12.3  | 12.9  | 112,746 | 東光           | 19    | —     | —         | 19    | —     | —         |
| <b>機械 (5.0%)</b>   |       |       |         |       |       |         | 大豊工業         | 6.6   | 6     | 6,708   | 6.6   | 6     | 6,708   | ホシデン         | 18.7  | 19.6  | 14,974    | 18.7  | 19.6  | 14,974    |
| 日本製鋼所              | 86    | 102   | 47,532  | 86    | 102   | 47,532  | 日本精工         | 117.1 | 118.7 | 124,397 | 117.1 | 118.7 | 124,397 | ヒロセ電機        | 9.5   | 9.2   | 119,324   | 9.5   | 9.2   | 119,324   |
| 三浦工業               | 25.5  | 27.2  | 54,073  | 25.5  | 27.2  | 54,073  | NTN          | 134   | 145   | 51,765  | 134   | 145   | 51,765  | 日本航空電子       | 17    | 17    | 26,656    | 17    | 17    | 26,656    |
| タクマ                | 20    | 23    | 21,045  | 20    | 23    | 21,045  | ジェイテクト       | 60.6  | 59.8  | 88,563  | 60.6  | 59.8  | 88,563  | TOA          | 7.4   | 7.9   | 7,102     | 7.4   | 7.9   | 7,102     |
| ツガミ                | 19    | 20    | 10,460  | 19    | 20    | 10,460  | 不二越          | 54    | 54    | 19,170  | 54    | 54    | 19,170  | 日立マクセル       | 10.1  | 9.8   | 15,346    | 10.1  | 9.8   | 15,346    |
| オークマ               | 40    | 40    | 30,240  | 40    | 40    | 30,240  | 日本トムソン       | 22    | 22    | 8,250   | 22    | 22    | 8,250   | 古野電機         | 9     | 10.1  | 5,423     | 9     | 10.1  | 5,423     |
| 東芝機械               | 35    | 34    | 11,254  | 35    | 34    | 11,254  | THK          | 37.4  | 37.9  | 72,957  | 37.4  | 37.9  | 72,957  | ユニデンホールディングス | 26    | 94    | 14,194    | 26    | 94    | 14,194    |
| アマダホールディングス        | 89    | 85.8  | 91,634  | 89    | 85.8  | 91,634  | ユージン精機       | 3.2   | 3.1   | 7,272   | 3.2   | 3.1   | 7,272   | アルパイン        | 14.2  | 14.4  | 17,049    | 14.2  | 14.4  | 17,049    |
| アイダエンジニア           | 14.3  | 16.9  | 13,148  | 14.3  | 16.9  | 13,148  | イーグル工業       | 8.8   | 7.7   | 9,871   | 8.8   | 7.7   | 9,871   | スミダコーポレーション  | 8.2   | —     | —         | 8.2   | —     | —         |
| 滝澤鉄工所              | 29    | 81    | 10,692  | 29    | 81    | 10,692  | 日本ピラー工業      | 8.5   | 7.5   | 7,005   | 8.5   | 7.5   | 7,005   | アイコム         | 4.3   | 4.2   | 8,110     | 4.3   | 4.2   | 8,110     |
| 富士機械製造             | 20.2  | 17.9  | 20,495  | 20.2  | 17.9  | 20,495  | キッツ          | 27.3  | 29.2  | 16,030  | 27.3  | 29.2  | 16,030  | 船井電機         | 6.7   | 6.7   | 5,514     | 6.7   | 6.7   | 5,514     |
| 牧野フライス             | 31    | 31    | 19,158  | 31    | 31    | 19,158  | 日立工機         | 15.4  | 7.2   | 5,133   | 15.4  | 7.2   | 5,133   | 横河電機         | 57.9  | 58.7  | 77,660    | 57.9  | 58.7  | 77,660    |
| オーエスジー             | 27.3  | 27.4  | 52,799  | 27.3  | 27.4  | 52,799  | マキタ          | 36.7  | 37.5  | 267,000 | 36.7  | 37.5  | 267,000 | 新電元工業        | 25    | 23    | 9,085     | 25    | 23    | 9,085     |
| 旭ダイヤモンド            | 17.3  | 17.2  | 14,035  | 17.3  | 17.2  | 14,035  | 日立造船         | 48.7  | 46.7  | 24,003  | 48.7  | 46.7  | 24,003  | アズビル         | 17.6  | 18.2  | 54,108    | 17.6  | 18.2  | 54,108    |
| DMG森精機             | 38.3  | 33.9  | 34,510  | 38.3  | 33.9  | 34,510  | 三菱重工         | 948   | 1,032 | 448,300 | 948   | 1,032 | 448,300 | 日本光電工業       | 23.7  | 24.2  | 55,176    | 23.7  |       |           |

| 銘柄                  | 期首    |       | 当期末       |    | 銘柄                   | 期首    |       | 当期末     |    | 銘柄                     | 期首    |       | 当期末     |    |
|---------------------|-------|-------|-----------|----|----------------------|-------|-------|---------|----|------------------------|-------|-------|---------|----|
|                     | 株数    | 千株    | 株数        | 千株 |                      | 株数    | 千株    | 株数      | 千株 |                        | 株数    | 千株    | 株数      | 千株 |
|                     |       |       | 千円        | 千円 |                      |       |       | 千円      | 千円 |                        |       |       | 千円      | 千円 |
| 京セラ                 | 92.9  | 95    | 473,670   |    | トプコン                 | 17.5  | 20.2  | 25,896  |    | 西日本鉄道                  | 76    | 76    | 37,164  |    |
| 太陽誘電                | 30.9  | 29.2  | 30,076    |    | オリンパス                | 84.1  | 87.5  | 314,562 |    | ハマキョウレックス              | 4.6   | 5.5   | 9,416   |    |
| 村田製作所               | 59.4  | 61.8  | 825,030   |    | 理研計器                 | 7     | 5.9   | 6,537   |    | サカイ引越センター              | 1.2   | 3     | 7,497   |    |
| ユージン                | 11.3  | 15.2  | 10,548    |    | タムロン                 | 5     | 5.4   | 8,823   |    | 近鉄グループHLDGS            | 562   | 577   | 242,340 |    |
| 双葉電子工業              | 10.1  | 10.3  | 16,706    |    | ＨＯＹＡ                 | 134.4 | 132.3 | 535,285 |    | 阪急阪神HLDGS              | 373   | 77.4  | 265,869 |    |
| 北陸電気工業              | 36    | 86    | 10,062    |    | ノーリツ機械               | 8.8   | 10.5  | 6,909   |    | 南海電鉄                   | 129   | 130   | 63,830  |    |
| ニチコン                | 19.2  | 19.3  | 15,420    |    | シチズンホールディングス         | 72.4  | 70.2  | 37,627  |    | 京阪ホールディングス             | 128   | 128   | 90,624  |    |
| 日本ケミコン              | 49    | 55    | 9,020     |    | リズム時計                | 39    | 37    | 6,660   |    | 神戸電鉄                   | 28    | 27    | 9,990   |    |
| KOA                 | 9.4   | 9.1   | 7,343     |    | 大研医器                 | 5.5   | 6.7   | 5,071   |    | 名古屋鉄道                  | 194   | 209   | 111,188 |    |
| 小糸製作所               | 34    | 34.7  | 165,345   |    | メニコン                 | 1.8   | 4.1   | 10,807  |    | 山陽電鉄                   | 25    | 27    | 14,310  |    |
| ミツバ                 | 11.2  | 10.3  | 13,019    |    | 松風                   | 4.6   | 4.4   | 5,689   |    | 日本通運                   | 219   | 221   | 111,384 |    |
| スター精密               | 11.7  | 11.9  | 14,327    |    | セイコーHD               | 43    | 38    | 11,818  |    | ヤマトホールディングス            | 99.4  | 106   | 257,845 |    |
| SCREENホールディングス      | 57    | 60    | 75,240    |    | ニプロ                  | 38.3  | 43.1  | 56,030  |    | 山九                     | 69    | 76    | 43,548  |    |
| キャンノン電子             | 5.4   | 6     | 9,210     |    | <b>その他製品 (2.0%)</b>  |       |       |         |    | 丸全昭和運輸                 | 24    | 24    | 8,760   |    |
| キャンノン               | 305   | 311   | 902,522   |    | パラマウントベッドHD          | 6.4   | 6.3   | 24,192  |    | センコー                   | 26    | 27    | 18,387  |    |
| リコー                 | 168.9 | 187.3 | 173,065   |    | 前田工業                 | 7.2   | 8     | 9,040   |    | トナミホールディングス            | 7     | 16    | 4,128   |    |
| MUTOHホールディングス       | 10    | —     | —         |    | 永大産業                 | 14    | 14    | 5,824   |    | ニッコンホールディングス           | 18.4  | 17.6  | 38,227  |    |
| 東京エレクトロン            | 47.7  | 47.9  | 439,434   |    | アートネイチャー             | 5.6   | 7.1   | 4,693   |    | 福山通運                   | 32    | 34    | 20,468  |    |
| <b>輸送用機器 (9.7%)</b> |       |       |           |    | バンダイナムコHLDGS         | 62.7  | 59.6  | 178,621 |    | セイノーホールディングス           | 43.7  | 40    | 43,840  |    |
| トヨタ紡織               | 20.6  | 20.5  | 46,412    |    | 共立印刷                 | —     | 38.4  | 11,673  |    | 神奈川中央交通                | 17    | 13    | 9,191   |    |
| 鬼怒川ゴム               | 17    | —     | —         |    | フランスベッドHLDGS         | 55    | 9.4   | 8,159   |    | 日立物流                   | 11.9  | 12.6  | 26,182  |    |
| ユニプレス               | 11.4  | 12.4  | 22,047    |    | パイロットコーポレーション        | 10.2  | 10.3  | 41,045  |    | 丸和運輸機関                 | 0.3   | —     | —       |    |
| 豊田自動織機              | 50.9  | 51.9  | 251,974   |    | トッパン・フォームズ           | 11.3  | 11    | 11,440  |    | <b>海運業 (0.2%)</b>      |       |       |         |    |
| モリタホールディングス         | 11.5  | 11    | 14,707    |    | フジシールインターナショナル       | 7.2   | 7.1   | 29,110  |    | 日本郵船                   | 479   | 507   | 94,302  |    |
| 三桜工業                | 12    | 10.4  | 6,531     |    | タカラトミー               | 24.2  | 20.1  | 19,637  |    | 商船三井                   | 298   | 283   | 65,939  |    |
| デンソー                | 139.7 | 143.1 | 592,004   |    | 廣済堂                  | 3.6   | —     | —       |    | 川崎汽船                   | 255   | 257   | 65,792  |    |
| 東海理化電機              | 15.4  | 16.7  | 31,930    |    | 大建工業                 | 33    | 28    | 10,528  |    | NSユニテッド海運              | 30    | 34    | 4,658   |    |
| 三井造船                | 230   | 231   | 32,571    |    | 凸版印刷                 | 159   | 160   | 148,640 |    | 飯野海運                   | 34.3  | 34.9  | 12,773  |    |
| 川崎重工業               | 411   | 449   | 139,190   |    | 大日本印刷                | 167   | 168   | 171,696 |    | <b>空運業 (0.6%)</b>      |       |       |         |    |
| 名村造船所               | 17    | 18.4  | 13,064    |    | 図書印刷                 | 14    | 15    | 7,140   |    | 日本航空                   | 107.5 | 110.4 | 336,499 |    |
| 日本車輌                | 23    | 30    | 7,800     |    | 共同印刷                 | 26    | 26    | 8,320   |    | ANAホールディングス            | 1,112 | 1,072 | 304,448 |    |
| ニチュ三菱フォークリフト        | 8.2   | —     | —         |    | 日本写真印刷               | 10.3  | 10.3  | 24,720  |    | <b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b> |       |       |         |    |
| 近畿車輛                | —     | 13    | 3,055     |    | 宝印刷                  | 6.4   | 7.8   | 10,280  |    | トランコム                  | 1.9   | 2     | 11,680  |    |
| 日産自動車               | 792.9 | 793.9 | 801,045   |    | アシックス                | 52.8  | 54.2  | 113,494 |    | 日新                     | 31    | 29    | 8,497   |    |
| いすゞ自動車              | 178.5 | 167.3 | 204,775   |    | ツツミ                  | 3.4   | 3.5   | 5,824   |    | 三菱倉庫                   | 38    | 39    | 59,397  |    |
| トヨタ自動車              | 782   | 742.2 | 4,417,574 |    | 小松ウオール工業             | 2.7   | 2.6   | 4,199   |    | 三井倉庫HOLD               | 41    | 39    | 11,583  |    |
| 日野自動車               | 81.7  | 82.1  | 89,489    |    | ヤマハ                  | 42.2  | 42.8  | 136,318 |    | 住友倉庫                   | 43    | 35    | 18,340  |    |
| 三菱自動車工業             | 206.8 | 233.8 | 107,548   |    | 河合楽器                 | 3.2   | 3     | 5,085   |    | 渋沢倉庫                   | 21    | 22    | 6,138   |    |
| エフテック               | 6     | 4.9   | 5,997     |    | クリナップ                | 7.2   | 9.1   | 7,534   |    | 東陽倉庫                   | 26    | 25    | 5,750   |    |
| 武蔵精密工業              | 7.1   | 6.5   | 15,496    |    | ピジヨン                 | 32.4  | 33.2  | 94,254  |    | 日本トランスシティ              | 20    | 18    | 6,372   |    |
| 日産車体                | 24.8  | 24.9  | 22,459    |    | キングジム                | 3.6   | 8.5   | 7,029   |    | 安田倉庫                   | 7.3   | 7.1   | 4,189   |    |
| 新明和工業               | 24    | 26    | 16,978    |    | リンテック                | 12.9  | 12.5  | 25,612  |    | 東洋埠頭                   | 31    | 79    | 12,324  |    |
| 極東開発工業              | 11.7  | 12.3  | 13,751    |    | T A S A K I          | 0.7   | —     | —       |    | 上組                     | 65    | 64    | 56,896  |    |
| 日信工業                | 10.8  | 13.1  | 20,108    |    | イトーキ                 | 14    | 13.8  | 8,859   |    | キューソー流通システム            | 0.9   | 2.9   | 6,594   |    |
| トビー工業               | 55    | 52    | 10,868    |    | 任天堂                  | 34.8  | 36.1  | 986,071 |    | 郵船ロジスティクス              | 6.2   | 6.7   | 6,586   |    |
| ティラド                | 33    | 35    | 6,720     |    | 三菱鉛筆                 | 4.6   | 4.6   | 21,620  |    | 近鉄エクスペレス               | 5.2   | 11.1  | 14,407  |    |
| 曙ブレーキ               | 30.7  | 43.2  | 8,899     |    | タカラスタンダード            | 24    | 23    | 20,332  |    | <b>情報・通信業 (8.4%)</b>   |       |       |         |    |
| タチエス                | 9.9   | 9.9   | 16,849    |    | コクヨ                  | 30.9  | 30.2  | 42,310  |    | NECネットエスアイ             | 7.3   | 7     | 12,159  |    |
| NOK                 | 27.4  | 27.9  | 56,748    |    | ナカバヤシ                | —     | 18    | 4,212   |    | システナ                   | 9.7   | 7.4   | 13,112  |    |
| フタバ産業               | 22    | 21.8  | 10,856    |    | グローブライド              | —     | 3.7   | 6,286   |    | デジタルアーツ                | 2.3   | 4.2   | 10,718  |    |
| K Y B               | 66    | 66    | 27,786    |    | 岡村製作所                | 23    | 20.7  | 19,809  |    | 新日鉄住金SOI               | 5.2   | 10.2  | 17,890  |    |
| シロキ工業               | 6     | —     | —         |    | 美津濃                  | 34    | 32    | 16,224  |    | T I S                  | —     | 19.4  | 48,150  |    |
| 大同メタル工業             | 9.4   | 9.2   | 10,304    |    | アデランス                | 8.2   | 13    | 5,512   |    | I Tホールディングス            | 19.2  | —     | —       |    |
| プレス工業               | 32.2  | 32.9  | 14,081    |    | <b>電気・ガス業 (1.9%)</b> |       |       |         |    | 電算システム                 | —     | 3.4   | 5,035   |    |
| カルソニックカンセイ          | 45    | 45    | 42,390    |    | 東京電力HD               | 479.5 | 494.9 | 207,363 |    | グリー                    | 34.9  | 36.3  | 22,360  |    |
| 太平洋工業               | 14.7  | 14    | 15,974    |    | 中部電力                 | 173.2 | 179.1 | 269,276 |    | コーエーテックモHD             | 13.9  | 14    | 26,236  |    |
| ケーヒン                | 13.6  | 13.2  | 21,463    |    | 関西電力                 | 231.1 | 241.3 | 222,285 |    | 三菱総合研究所                | 3.3   | 2.9   | 9,309   |    |
| 河西工業                | 9.1   | 8.3   | 8,582     |    | 中国電力                 | 76.9  | 78.3  | 105,783 |    | ファインテックス               | 3.2   | —     | —       |    |
| アイシン精機              | 51.1  | 59    | 275,825   |    | 北陸電力                 | 54.8  | 55.4  | 70,690  |    | K L a b                | 8.1   | 11    | 6,688   |    |
| 富士機工                | 4.5   | 10.3  | 3,440     |    | 東北電力                 | 140.6 | 145.3 | 199,642 |    | ポルトウウィン・ピットクル          | 3.2   | 9.1   | 7,562   |    |
| マツダ                 | 168.3 | 182.9 | 289,164   |    | 四国電力                 | 50.9  | 51.6  | 54,902  |    | ネクソン                   | 54.2  | 56.1  | 83,252  |    |
| ダイハツ                | 65    | —     | —         |    | 九州電力                 | 124.7 | 130.2 | 124,210 |    | アイスタイル                 | 1.8   | 11    | 8,404   |    |
| 今仙電機製作所             | 6     | 7.4   | 6,334     |    | 北海道電力                | 53.4  | 55.2  | 48,576  |    | エイチーム                  | 1.7   | 4.4   | 9,605   |    |
| 本田技研                | 509.6 | 523.6 | 1,550,379 |    | 沖縄電力                 | 6.3   | 9.6   | 22,310  |    | e n i s h              | 0.9   | —     | —       |    |
| スズキ                 | 118.1 | 107.9 | 362,004   |    | 電源開発                 | 40.2  | 48.8  | 124,391 |    | コロブラ                   | 14.9  | 16.4  | 24,714  |    |
| 富士重工業               | 192.4 | 184.8 | 705,012   |    | 東邦瓦斯                 | 690   | 649   | 305,614 |    | オルトプラス                 | 1.1   | —     | —       |    |
| ヤマハ発動機              | 79.5  | 81.2  | 159,476   |    | 大阪瓦斯                 | 588   | 594   | 253,816 |    | ブロードリーフ                | 5.3   | 7.8   | 8,572   |    |
| ショーワ                | 14.6  | 15.9  | 8,713     |    | 東邦瓦斯                 | 141   | 145   | 137,025 |    | ハーツユニテッドグループ           | 1.3   | —     | —       |    |
| T B K               | 11.3  | 25.4  | 10,287    |    | 北海道瓦斯                | 28    | 34    | 9,452   |    | ブイキューブ                 | 1     | —     | —       |    |
| エクセディ               | 8     | 7.2   | 18,309    |    | 広島ガス                 | —     | 23.3  | 7,479   |    | ティーガイア                 | 6.6   | 6.2   | 8,785   |    |
| 豊田合成                | 18.5  | 19    | 45,448    |    | 西部瓦斯                 | 72    | 67    | 16,683  |    | 豆蔵ホールディングス             | 3.1   | —     | —       |    |
| 菱三工業                | 11.1  | 11.2  | 8,825     |    | 静岡ガス                 | 17.6  | 18.7  | 14,866  |    | ガンホー・オンライン・エンター        | —     | 133.3 | 32,125  |    |
| ヨロズ                 | 6.1   | 5.8   | 8,595     |    | メタウォーター              | 2.4   | 3.9   | 10,592  |    | GMOペイメントゲートウェイ         | 5.4   | 5.2   | 24,830  |    |
| エフ・シー・シー            | 9.2   | 9.8   | 21,805    |    | <b>陸運業 (4.3%)</b>    |       |       |         |    | インターネットイニシアティブ         | 9.9   | 9.9   | 18,572  |    |
| シノノ                 | 22.7  | 23.6  | 364,384   |    | SBSホールディングス          | 5.9   | 7.7   | 7,099   |    | SRAホールディングス            | 2.1   | 4.3   | 9,240   |    |
| タカタ                 | 8.5   | —     | —         |    | 東武鉄道                 | 303   | 309   | 158,517 |    | 朝日ネット                  | 14.3  | 15    | 6,465   |    |
| テイ・エス・テック           | 12.3  | 13.4  | 34,478    |    | 相鉄ホールディングス           | 100   | 98    | 50,666  |    | g u m i                | 4.4   | 8.1   | 6,212   |    |
| ジャムコ                | 1.8   | 4.2   | 8,568     |    | 東京急行                 | 306   | 339   | 264,759 |    | LINE                   | —     | 9.5   | 41,895  |    |
| <b>精密機器 (1.5%)</b>  |       |       |           |    | 京浜急行                 | 151   | 155   | 158,720 |    | 野村総合研究所                | 31.5  | 40.5  | 140,535 |    |
| テルモ                 | 86.6  | 89.9  | 352,408   |    | 小田急電鉄                | 181   | 186   | 209,994 |    | インテージホールディングス          | 4.5   | 4.3   | 6,888   |    |
| 日機装                 | 19.8  | 22.4  | 19,555    |    | 京王電鉄                 | 159   | 162   | 143,694 |    | フジ・メディア・HD             | 58.2  | 58.7  | 77,894  |    |
| 島津製作所               | 68    | 74    | 112,480   |    | 京成電鉄                 | 86    | 87    | 111,447 |    | オービック                  | 19.3  | 19.9  | 103,679 |    |
| JMS                 | 24    | 20    | 5,320     |    | 富士急行                 | 17    | 17    | 19,992  |    | ジャストシステム               | 10.2  | 12.9  | 11,055  |    |
| クボテック               | 0.6   | —     | —         |    | 新京成電鉄                | 21    | 25    | 9,750   |    | ヤフー                    | 400.4 | 424.3 | 173,538 |    |
| バイ・テクノロジー           | 0.7   | 1.7   | 18,615    |    | 東日本旅客鉄道              | 103.8 | 106.6 | 956,628 |    | トレンドマイクロ               | 27.6  | 28.1  | 99,333  |    |
| 東京計器                | 28    | 42    | 6,762     |    | 西日本旅客鉄道              | 54.4  | 55.9  | 348,145 |    | 日本オラクル                 | 8.8   | 9.6   | 57,984  |    |

トピックス・インデックス・マザーファンド

| 銘柄             | 期首    |       |           | 当期末            |       |       | 銘柄      | 期首               |         |         | 当期末       |    |    | 銘柄 | 期首 |    |    | 当期末 |    |    |
|----------------|-------|-------|-----------|----------------|-------|-------|---------|------------------|---------|---------|-----------|----|----|----|----|----|----|-----|----|----|
|                | 株数    | 千株    | 千円        | 株数             | 千株    | 千円    |         | 株数               | 千株      | 千円      | 株数        | 千株 | 千円 |    | 株数 | 千株 | 千円 | 株数  | 千株 | 千円 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 13.2  | 13.3  | 34,486    | 日本紙パルプ         | 19    | 28    | 9,212   | コスモス薬品           | 2.9     | 2.9     | 57,014    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| アイティフォー        | 14.8  | 24    | 13,896    | 日立ハイテクノロジーズ    | 19.4  | 19.5  | 74,490  | セブン&アイ・HLDGS     | 233.9   | 241.4   | 1,097,404 |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 大塚商会           | 15.1  | 15.8  | 75,919    | カメイ            | 9.6   | 8.5   | 6,927   | 薬王堂              | 0.3     | —       | —         |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| サイボウズ          | —     | 27.5  | 13,282    | 東都水産           | —     | 28    | 4,508   | クリエイト・レストランツ・ホール | 4.7     | 16.8    | 17,136    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 電通国際情報S        | 5.8   | 4.5   | 8,433     | スターゼン          | 30    | 2.5   | 11,975  | ツルハホールディングス      | 11.9    | 13.5    | 145,125   |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| ウェザーニューズ       | 2.5   | 2.5   | 7,675     | 山善             | 23.3  | 23.4  | 17,994  | サンマルクホールディングス    | 4.6     | 4.8     | 13,190    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| C I J          | —     | 14.1  | 6,387     | 住友商事           | 325.1 | 355.2 | 395,692 | トリドール            | 6.8     | 7.3     | 16,563    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| WOWOW          | 3.3   | 3.5   | 9,737     | 内田洋行           | 20    | 19    | 8,075   | クスリのアオキ          | 4.8     | 5.5     | 21,450    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| フュージョンパートナー    | 1.6   | —     | —         | 三菱商事           | 426.9 | 431.9 | 917,355 | メディカルシステムネットワーク  | 2.9     | 14.9    | 7,017     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| イマジカ・ロボットHD    | 2.9   | —     | —         | 第一実業           | 19    | 18    | 9,270   | 総合メディカル          | 3.4     | 3.1     | 10,307    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| ネットワンシステムズ     | 25.1  | 26.6  | 18,779    | キャノンマーケティングJPN | 15.8  | 16.3  | 29,454  | カッパ・クリエイト        | 9.9     | 9.4     | 11,703    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| マーベラス          | 10.6  | 11.6  | 8,758     | 西華産業           | 26    | 29    | 7,627   | ライトオン            | —       | 5.7     | 6,857     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| エイベックス・グループHD  | 11.5  | 11.2  | 15,489    | 菱洋エレクトロ        | 7.9   | 7.7   | 9,216   | 良品計画             | 6.9     | 6.7     | 128,908   |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 日本ユニシス         | 17.7  | 16.8  | 21,386    | ユアサ商事          | 5.7   | 6.1   | 13,212  | アルビス             | —       | 2.3     | 4,797     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 兼松エレクトロニクス     | 6.6   | 5.2   | 9,729     | 神鋼商事           | 30    | 54    | 9,558   | コナカ              | 9.1     | 11      | 5,423     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 東京放送HD         | 34.4  | 33.7  | 49,471    | 阪和興業           | 59    | 59    | 35,046  | コーナン商事           | 10.6    | 8.9     | 17,043    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 日本テレビHD        | 51.2  | 51.9  | 85,790    | カナデン           | 10.8  | 10.1  | 9,625   | ワタミ              | 8.6     | 9       | 10,440    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 朝日放送           | 1.4   | —     | —         | 菱電商事           | 14    | 13    | 8,762   | ドンキホーテホールディング    | 36      | 37.2    | 132,432   |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| テレビ朝日HD        | 16    | 16    | 28,784    | 岩谷産業           | 60    | 67    | 38,994  | 西松屋チェーン          | 12.3    | 12      | 17,616    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| スカパーJSATHD     | 48.9  | 46.7  | 22,135    | すてきなイスグループ     | 37    | 36    | 4,968   | ゼンショーホールディングス    | 28.5    | 29.4    | 52,243    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| テレビ東京HD        | 5.5   | 6.2   | 13,410    | 昭光通商           | 44    | —     | —       | 幸楽苑ホールディングス      | 6.2     | 5.6     | 8,635     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| コネクショ          | 6.7   | 6.7   | 9,011     | 三菱石油           | 17    | 15    | 9,615   | サイゼリヤ            | 8.9     | 9.8     | 22,383    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 日本通信           | 25.6  | 46    | 8,234     | 稲畑産業           | 15.4  | 15.2  | 14,835  | V Tホールディングス      | 14.7    | 21.7    | 9,699     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 日本電信電話         | 437.5 | 444   | 2,048,616 | ワキタ            | 13.5  | 12.8  | 9,587   | ユナイテッドアローズ       | 7.4     | 8.3     | 20,351    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| KDDI           | 568   | 569.3 | 1,746,043 | 東邦ホールディングス     | 19.6  | 18.7  | 39,681  | ハイデイ日高           | 4.9     | 5.6     | 12,829    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 光通信            | 5     | 6.8   | 62,220    | サンゲツ           | 19.6  | 20    | 37,100  | 京都市もの友禅          | 8.1     | 8.5     | 7,539     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| NTTドコモ         | 431.2 | 429.5 | 1,099,090 | ミツウロコグループ      | 14.2  | 10.9  | 5,831   | コロワイド            | 20      | 19.3    | 36,477    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| エムティーアイ        | 5.5   | 10.6  | 6,646     | シナネンホールディングス   | 19    | 16    | 6,304   | 壱番屋              | 2.8     | 5.4     | 17,604    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| GMOインターネット     | 19.9  | 22.2  | 29,015    | 伊藤忠エネクス        | 14.5  | 15.2  | 11,901  | スキホールディングス       | 9.9     | 10.2    | 54,264    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| カドカワ           | 14.3  | 18.3  | 25,107    | サンリオ           | 15.7  | 17.5  | 32,847  | スクロール            | —       | 19.8    | 7,385     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 学研ホールディングス     | 32    | 28    | 8,456     | サンワテクノス        | 5.6   | 5.9   | 4,200   | ヨンドシーホールディングス    | 4.9     | 4.8     | 10,790    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| ゼンリン           | 9.7   | 8.4   | 14,439    | リョーサン          | 9.9   | 9.1   | 28,346  | ユニ・ファミリーマートHD    | 18.5    | 25.6    | 173,572   |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 松竹             | 39    | 38    | 43,890    | 新光商事           | 8.6   | 7.7   | 7,869   | 木曾路              | 6.9     | 7.9     | 17,925    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 東宝             | 40    | 40.9  | 135,788   | トーホー           | 4.6   | 3.6   | 8,254   | サトレストランシステムズ     | —       | 10.4    | 8,663     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 東映             | 23    | 22    | 17,622    | 三信電気           | 9.4   | 9.6   | 8,448   | 千趣会              | 12.9    | 14.2    | 9,443     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| N T Tデータ       | 34.7  | 36.4  | 189,644   | 東陽テクニカ         | 10.3  | 10.4  | 10,452  | ケーヨー             | 14.7    | 13.2    | 6,679     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| D T S          | 6.9   | 7.2   | 15,940    | モスフード サービス     | 7.3   | 7.7   | 24,293  | 上新電機             | 13      | 15      | 12,735    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| スクウェア・エニックス・HD | 22    | 24.4  | 78,324    | 加賀電子           | 6.1   | 6     | 7,206   | 日本瓦斯             | 9.3     | 9       | 28,080    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| シーイーシー         | 6.2   | 5.9   | 11,003    | PAL TAC        | 9.7   | 9.4   | 21,902  | ロイヤルホールディングス     | 10.4    | 10      | 17,180    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| カプコン           | 15.3  | 14.9  | 33,629    | 三谷産業           | 3.2   | —     | —       | いなげや             | 6.9     | 7.6     | 10,396    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| ジャストテック        | 8.7   | 10.7  | 10,946    | ヤマタネ           | 49    | 77    | 10,164  | 島忠               | 14      | 14.6    | 35,127    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| S C S K        | 13.8  | 14.2  | 55,664    | 日鉄住金物産         | 34    | 47    | 16,826  | チヨダ              | 6.9     | 6.8     | 16,401    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| アイネス           | 9.7   | 10.1  | 11,524    | トラスコ中山         | 6.9   | 6.9   | 35,742  | ライフコーポレーション      | 4       | 4.1     | 12,648    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| T K C          | 5.9   | 5.8   | 17,179    | オートバックスセブン     | 19.8  | 21.5  | 31,820  | リンガーハット          | 6.3     | 5.8     | 13,258    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 富士ソフト          | 8.7   | 9     | 24,723    | 加藤産業           | 8.5   | 8.2   | 18,163  | AOKIホールディングス     | 13.6    | 13.4    | 15,356    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| N S D          | 15.7  | 13.1  | 20,684    | イノテック          | —     | 19.1  | 9,416   | オークワ             | 10      | 10      | 9,370     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| コナミホールディングス    | 23.4  | 26.1  | 99,832    | イエローハット        | 5.9   | 5.8   | 11,663  | コメリ              | 9.8     | 8.7     | 20,610    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| JBCホールディングス    | 10.4  | 10    | 6,640     | 日伝             | 2.6   | 2.9   | 8,244   | 青山商事             | 14.1    | 10.9    | 37,877    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| ミロク情報サービス      | —     | 6.6   | 11,431    | 因幡電機産業         | 8.3   | 6.8   | 23,698  | しまむら             | 6.4     | 6.7     | 79,194    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| ソフトバンクグループ     | 295.6 | 327   | 2,117,979 | ミスミグループ本社      | 63.3  | 64    | 114,624 | 高島屋              | 82      | 84      | 68,796    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 卸売業 (4.2%)     |       |       |           | スズキ            | 25.3  | 25.8  | 83,592  | 松屋               | 12      | 12.5    | 9,000     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| JALUX          | —     | 3     | 5,001     | ジェコ            | 4.9   | 4.9   | 4,125   | エイチ・ツー・オーリテイリング  | 26.9    | 29.2    | 42,427    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| あたら            | 4.1   | 3     | 6,813     | 小売業 (4.8%)     |       |       |         | 近鉄百貨店            | 21      | 27      | 9,126     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| フィールズ          | 2.3   | 4.7   | 5,978     | ローソン           | 20.7  | 22    | 172,260 | ニッセンHD           | 17.9    | —       | —         |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 双日             | 383.8 | 366.7 | 92,775    | サンエー           | 4.5   | 4     | 19,360  | パルコ              | 8.2     | 6.6     | 6,408     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| アルフレッサホールディングス | 65.5  | 71.4  | 151,153   | カワチ薬品          | 5.3   | 4.9   | 11,686  | 丸井グループ           | 60      | 70.6    | 99,616    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 横浜冷凍           | 17.5  | 15.7  | 15,700    | エービーシー・マート     | 8     | 7.6   | 50,616  | アクシアルリテイリング      | 5       | 4.8     | 15,480    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| アルコニクス         | 4.4   | 5.3   | 7,186     | ハードオフコーポレーション  | —     | 6.9   | 7,721   | イオン              | 229.6   | 238.5   | 355,365   |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 神戸物産           | 2     | 4.3   | 9,558     | アスクル           | 5.9   | 7.2   | 26,640  | ユニーグループ・HD       | 57.8    | —       | —         |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| あいホールディングス     | 9.8   | 10.8  | 24,915    | ゲオホールディングス     | 12    | 11.2  | 14,784  | イズミ              | 12.7    | 11.2    | 47,712    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| ダイワボウHD        | 67    | 58    | 13,514    | アダストリア         | 5     | 10.9  | 24,252  | 東武ストア            | 18      | 1.7     | 4,722     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| マクニカ・富士エレHLDGS | 10.8  | 10.9  | 12,088    | くらコーポレーション     | 3.8   | 3.6   | 16,884  | 平和堂              | 12.1    | 11.7    | 24,078    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| バイタルK S K HD   | 12.7  | 11.1  | 11,266    | キャンドウ          | 4.9   | 5.6   | 9,010   | フジ               | 7       | 6.8     | 13,219    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| UKCホールディングス    | 4.6   | 4.3   | 7,030     | パールグループHLDGS   | 3.7   | 3.7   | 8,558   | ヤオコー             | 6.7     | 6.6     | 26,664    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| TOKAIホールディングス  | 30.1  | 29.3  | 19,338    | エディオン          | 27.6  | 24.8  | 21,377  | ゼビオホールディングス      | 7.9     | 8       | 12,488    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 三洋貿易           | 5.5   | 5.3   | 6,444     | あみやき亭          | 1.4   | 1.5   | 5,490   | ケーズホールディングス      | 13      | 23.8    | 40,483    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| シップヘルスケアHD     | 10.6  | 11.8  | 34,833    | ひらまつ           | 11    | 12.6  | 7,320   | アインホールディングス      | 7.1     | 7.1     | 44,588    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 小野建            | 6.6   | 6.5   | 7,839     | ゲンキー           | 0.9   | 1.7   | 6,196   | ヤマダ電機            | 217.2   | 170.9   | 86,817    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 佐島電機           | —     | 14.2  | 9,684     | ハンリーズ          | 6     | 6.7   | 8,227   | アークランドサカモト       | 4.6     | 10.7    | 11,994    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| ナガイレーベン        | 8.6   | 9.3   | 19,213    | アルペン           | 5.3   | 5.5   | 10,081  | ニトリホールディングス      | 24      | 25.3    | 282,348   |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 三菱食品           | 5.9   | 6.4   | 19,392    | クオール           | 6.8   | 6.8   | 9,533   | 吉野家ホールディングス      | 15.5    | 21.2    | 30,485    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 松田産業           | 5.6   | 5.9   | 7,675     | ジェイアイエヌ        | 4.1   | 4.1   | 18,163  | 松屋フーズ            | 3.4     | 3.6     | 10,836    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 第一興商           | —     | 10.2  | 40,392    | ビックカメラ         | 26.9  | 32.6  | 27,416  | サガミチェーン          | 9       | 9.5     | 11,913    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| メディアパルHD       | 55.6  | 56.5  | 97,180    | DCMホールディングス    | 28.6  | 28    | 24,024  | 王将フードサービス        | 4       | 4.3     | 17,479    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| アズワン           | 4.6   | 4.8   | 20,424    | Monotaro       | 10.1  | 21    | 55,650  | ブレナス             | 6.6     | 6.7     | 12,127    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| シモジマ           | 6.5   | 6.3   | 6,356     | アークランドサービスHD   | 0.6   | 2.6   | 7,904   | ミニストップ           | 5.3     | 4.9     | 8,584     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| ドウシシャ          | 7.9   | 7.4   | 15,569    | J. フロントリテイリング  | 71.2  | 72.4  | 92,382  | アークス             | 9.9     | 10.7    | 26,215    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 黒田電気           | 10.1  | 11.2  | 21,772    | ドトール・日レスHD     | 10.3  | 10.2  | 19,033  | パローホールディングス      | 12.8    | 12.4    | 35,290    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 丸文             | 3     | 11.8  | 6,690     | マツモトキヨシHLDGS   | 12.7  | 11.9  | 60,095  | ベルク              | 3.2     | 3.1     | 11,470    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| ハピネット          | 4.4   | 6.5   | 6,682     | プロンコビリー        | 1.6   | 3.3   | 9,810   | ファーストリテイリング      | 11.2    | 9.7     | 315,347   |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| エクセル           | 2     | 4.2   | 5,031     | スタートトゥデイ       | 17.7  | 18    | 89,550  | サンドラッグ           | 11.8    | 12.4    | 98,580    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| J DOM          | 18.1  | 16.6  | 9,412     | トレジャー・ファクトリー   | 0.6   | —     | —       | サクスパーホールディング     | 5.1     | 7       | 7,266     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 進和             | —     | 4.9   | 6,992     | 物語コーポレーション     | 1.8   | 1.9   | 8,483   | ペルーナ             | 17.1    | 15.9    | 9,762     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| シークス           | 4.1   | 4     | 16,020    | ココカラファイン       | 6.2   | 6.1   | 23,088  | 銀行業 (7.7%)       |         |         |           |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 伊藤忠            | 465.3 | 452.9 | 560,690   | 三越伊勢丹HD        | 111.3 | 113.5 | 116,905 | じもとホールディングス      | 47.1    | 51.6    | 7,224     |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 丸紅             | 484.1 | 559.5 | 284,785   | ウエルシアHD        | 5.3   | 5.1   | 33,915  | 足利ホールディングス       | 33.8    | 42.2    | 16,922    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 高島             | —     | 66    | 10,626    | クリエイトSDH       | 2.9   | 8.9   | 20,407  | 東京TYフィナンシャルG     | 7.5     | 8.3     | 23,430    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 長瀬産業           | 30.7  | 26    | 31,616    | チムニー           | 0.9   | 2     | 5,376   | 九州フィナンシャルG       | —       | 86      | 55,126    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 蝶理             | 5     | 4.7   | 6,669     | ジョイフル本田        | 7.4   | 9.3   | 23,919  | ゆうちょ銀行           | —       | 150.5   | 184,362   |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 豊田通商           | 62.3  | 62.1  | 147,363   | すかいらく          | 17.9  | 17.7  | 23,452  | コンロディア・フィナンシャル   | —       | 393.2   | 190,977   |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 三共生興           | 17.4  | 13.2  | 4,224     | ユナイテッド・スーパーマーケ | 19.8  | 19.4  | 19,050  | 新生銀行             | 543     | 519     | 79,407    |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 兼松             | 121   | 129   | 19,479    | あさひ            | 4.5   | 5.3   | 6,815   | あおぞら銀行           | 390     | 372     | 132,060   |    |    |    |    |    |    |     |    |    |
| 三井物産           | 470.2 | 520.7 | 699,560   | 日本調剤           | 0.6   | 1.9   | 7,581   | 三菱UFJフィナンシャルG    | 4,488.1 | 4,616.9 | 2,379,550 |    |    |    |    |    |    |     |    |    |

| 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          |      |      |        |
| りそなホールディングス  | 655.7   | 673.8   | 292,429   | カブドットコム証券      | 54.2  | 55.8  | 18,525  | ツクイ             | 9.1   | 17    | 12,138  | エムスリー         | 51.8    | 54.1    | 165,275   | ツカダ・グローバルHOLD | 6.6   | 6.8   | 4,583   |              |      |      |        |
| 三井住友トラストHD   | 1,237   | 1,195   | 409,287   | 極東証券           | 9.4   | 9.9   | 13,295  | アウトソーシング        | 2.3   | 3.3   | 11,946  | ウェルネット        | 1.5     | 6.3     | 8,328     | ディー・エヌ・エー     | 29.8  | 28.1  | 107,342 | 博報堂D Y HLDGS | 81.4 | 83.4 | 95,826 |
| 三井住友フィナンシャルG | 422.8   | 461.2   | 1,585,144 | 岩井コスモホールディング   | 7.2   | 7.8   | 7,176   | ヘルカム            | 2.5   | 3.3   | 19,747  | エスアール・データカメラ  | 3.3     | —       | —         | 博報堂D Y HLDGS  | 81.4  | 83.4  | 95,826  |              |      |      |        |
| 第四銀行         | 70      | 66      | 26,202    | 藍澤証券           | 5     | 14.1  | 7,966   | エム・エル           | 4.1   | 8     | 20,728  | イオンファンタジー     | —       | 3       | 7,851     | ネクシィーズグループ    | 1.5   | —     | —       |              |      |      |        |
| 北越銀行         | 68      | 64      | 14,272    | マネースクウェアHD     | 1.4   | 7.8   | 9,703   | みらかホールディングス     | 15.2  | 15.3  | 77,418  | みらかホールディングス   | 15.2    | 15.3    | 77,418    | アルプス技研        | 1.7   | 3.8   | 8,029   |              |      |      |        |
| 西日本シティ銀行     | 194     | 178     | 36,668    | 保険業 (2.4%)     | —     | —     | —       | オリエンタルランド       | 63.7  | 66.3  | 408,474 | オリエンタルランド     | 63.7    | 66.3    | 408,474   | オリエントエージェンシー  | 1.4   | —     | —       |              |      |      |        |
| 千葉銀行         | 216     | 218     | 128,402   | かんぽ生命保険        | —     | 24.4  | 55,510  | ダスキン            | 16.9  | 17.3  | 31,849  | ダスキン          | 16.9    | 17.3    | 31,849    | オリエントエージェンシー  | 1.4   | —     | —       |              |      |      |        |
| 横浜銀行         | 375     | —       | —         | 損保ジャパン興亜HD     | 124.2 | 126.9 | 401,004 | 明光ネットワークジャパン    | 8.3   | 8.9   | 8,588   | 明光ネットワークジャパン  | 8.3     | 8.9     | 8,588     | サイバーエージェント    | 13.9  | 16.2  | 89,748  |              |      |      |        |
| 常陽銀行         | 197     | 198     | 93,456    | アニコムホールディングス   | 2.5   | 5.2   | 12,594  | フアルコホールディングス    | 5.1   | 4.1   | 5,362   | フアルコホールディングス  | 5.1     | 4.1     | 5,362     | 楽天            | 275.5 | 310.8 | 412,742 |              |      |      |        |
| 群馬銀行         | 128     | 122     | 57,462    | M S & A D      | 178.3 | 170.3 | 495,487 | ラウンドワン          | 19.1  | 20.8  | 14,851  | ラウンドワン        | 19.1    | 20.8    | 14,851    | セントラルスポーツ     | 4     | 3     | 7,230   |              |      |      |        |
| 武蔵野銀行        | 9       | 8.9     | 24,172    | S O N Y F H    | 54    | 56.5  | 83,789  | リゾートトラスト        | 22.9  | 25.2  | 51,332  | リゾートトラスト      | 22.9    | 25.2    | 51,332    | テイクワンホールディングス | 4.8   | 8     | 6,704   |              |      |      |        |
| 千葉興業銀行       | 13.9    | 19      | 7,543     | 第一生命           | 358.2 | 365.3 | 525,484 | ピー・エム・エル        | 4.1   | 8     | 20,728  | ピー・エム・エル      | 4.1     | 8       | 20,728    | テクノプロ・ホールディング | 7.7   | 10.3  | 35,586  |              |      |      |        |
| 筑波銀行         | 27.7    | 27.4    | 8,192     | 東京海上HD         | 226.7 | 231.8 | 903,324 | ライオン            | 13.3  | 13.4  | 48,843  | ライオン          | 13.3    | 13.4    | 48,843    | ジャパンマテリア      | 1.9   | 3.2   | 11,056  |              |      |      |        |
| 七十七銀行        | 92      | 87      | 36,279    | T&Dホールディングス    | 203.9 | 207.8 | 253,931 | 日本証券金融          | 26.4  | 24.1  | 10,700  | 日本証券金融        | 26.4    | 24.1    | 10,700    | ペクトル          | —     | 8.4   | 7,551   |              |      |      |        |
| 青森銀行         | 50      | 43      | 13,330    | その他金融業 (1.3%)  | —     | —     | —       | アイフル            | 93.3  | 98.2  | 30,834  | アイフル          | 93.3    | 98.2    | 30,834    | キャリアリンク       | 0.3   | —     | —       |              |      |      |        |
| 秋田銀行         | 43      | 40      | 12,280    | クレディセゾン        | 45.9  | 43.5  | 75,255  | ポケットカード         | —     | 9.4   | 4,794   | ポケットカード       | —       | 9.4     | 4,794     | N・フィールド       | 1.7   | —     | —       |              |      |      |        |
| 山形銀行         | 35      | 34      | 14,484    | アクリーティブ        | 1.9   | —     | —       | リコリース           | 5.3   | 4.9   | 12,960  | リコリース         | 5.3     | 4.9     | 12,960    | リクルートホールディング  | 88.9  | 124.1 | 475,923 |              |      |      |        |
| 岩手銀行         | 4       | 4.1     | 16,687    | 芙蓉総合リース        | 6.2   | 6.7   | 32,897  | リコーリース          | 5.3   | 4.9   | 12,960  | リコーリース        | 5.3     | 4.9     | 12,960    | 日本郵政          | —     | 180.8 | 241,910 |              |      |      |        |
| 東邦銀行         | 52      | 49      | 17,444    | 興銀リース          | 11.2  | 11.1  | 22,344  | イオン             | 131.8 | 248.4 | 49,431  | イオン           | 131.8   | 248.4   | 49,431    | リログループ        | 2.2   | 2.4   | 37,032  |              |      |      |        |
| 東北銀行         | —       | 89      | 12,994    | 東京センチュリーリース    | 13.3  | 13.4  | 48,843  | 日立キャピタル         | 11.4  | 13.9  | 31,024  | 東祥            | 0.7     | 2.2     | 9,878     | エイチ・アイ・エス     | 10    | 10    | 26,040  |              |      |      |        |
| みちのく銀行       | 32      | 30      | 6,090     | 日本証券金融         | 26.4  | 24.1  | 10,700  | アプラスフィナンシャル     | 21    | —     | —       | エイチ・アイ・エス     | 10      | 10      | 26,040    | 共立メンテナンス      | 3.8   | 4.7   | 30,315  |              |      |      |        |
| ふくおかフィナンシャルG | 227     | 246     | 102,582   | アイフル           | 93.3  | 98.2  | 30,834  | アコム             | 113.3 | 122.6 | 59,951  | 共立メンテナンス      | 3.8     | 4.7     | 30,315    | イチネンホールディング   | 10.2  | 11.7  | 10,834  |              |      |      |        |
| 静岡銀行         | 164     | 165     | 136,455   | アクリーティブ        | 1.9   | —     | —       | ジャックス           | 33    | 33    | 13,068  | イチネンホールディング   | 10.2    | 11.7    | 10,834    | 建設技術研究所       | 4.8   | 5.7   | 5,130   |              |      |      |        |
| 十六銀行         | 71      | 69      | 20,286    | 芙蓉総合リース        | 6.2   | 6.7   | 32,897  | オリコ             | 131.8 | 248.4 | 49,431  | 建設技術研究所       | 4.8     | 5.7     | 5,130     | 東京テアトル        | 47    | 98    | 11,662  |              |      |      |        |
| スルガ銀行        | 57.7    | 56.6    | 139,405   | 興銀リース          | 11.2  | 11.1  | 22,344  | 日立キャピタル         | 11.4  | 13.9  | 31,024  | 建設技術研究所       | 4.8     | 5.7     | 5,130     | よみうりランド       | 17    | 18    | 8,442   |              |      |      |        |
| 八十二銀行        | 99      | 97      | 50,925    | 東京センチュリーリース    | 13.3  | 13.4  | 48,843  | アプラスフィナンシャル     | 21    | —     | —       | よみうりランド       | 17      | 18      | 8,442     | 東京都競馬         | 47    | 45    | 8,955   |              |      |      |        |
| 山梨中央銀行       | 37      | 34      | 14,280    | 日本証券金融         | 26.4  | 24.1  | 10,700  | オリックス           | 394.5 | 408.8 | 601,140 | 東京都競馬         | 47      | 45      | 8,955     | 常盤興産          | 44    | 79    | 12,245  |              |      |      |        |
| 大垣共立銀行       | 72      | 75      | 26,175    | アイフル           | 93.3  | 98.2  | 30,834  | 三菱UFJリース        | 138.1 | 141.1 | 65,047  | 常盤興産          | 44      | 79      | 12,245    | カナモト          | 8.7   | 8.6   | 20,700  |              |      |      |        |
| 福井銀行         | 51      | 51      | 13,209    | ポケットカード        | —     | 9.4   | 4,794   | 日本取引所グループ       | 81.6  | 166.7 | 269,053 | カナモト          | 8.7     | 8.6     | 20,700    | 東都ドーム         | 48    | 26    | 25,480  |              |      |      |        |
| 北國銀行         | 60      | 59      | 18,408    | リコーリース         | 5.3   | 4.9   | 12,960  | イー・ギャランティ       | 1.2   | 3.1   | 8,063   | 東都ドーム         | 48      | 26      | 25,480    | 西尾レントオール      | 5.2   | 5.1   | 13,856  |              |      |      |        |
| 清水銀行         | 2.6     | 2.7     | 7,360     | イオンフィナンシャルサービス | 37.1  | 37.4  | 66,833  | NECキャピタルソリューション | 3.6   | 3.4   | 5,589   | 西尾レントオール      | 5.2     | 5.1     | 13,856    | トランス・コスモス     | 8.4   | 7.6   | 19,760  |              |      |      |        |
| 滋賀銀行         | 53      | 49      | 24,451    | アコム            | 113.3 | 122.6 | 59,951  | 不動産業 (2.5%)     | —     | —     | —       | トランス・コスモス     | 8.4     | 7.6     | 19,760    | 乃村工務社         | 13    | 13.9  | 19,293  |              |      |      |        |
| 南都銀行         | 49      | 52      | 19,084    | ジャックス          | 33    | 33    | 13,068  | いちご             | —     | 60.9  | 26,004  | 乃村工務社         | 13      | 13.9    | 19,293    | 藤田観光          | 27    | 25    | 8,975   |              |      |      |        |
| 百五銀行         | 55      | 50      | 18,900    | 野村不動産HLDGS     | 33.8  | 37    | 62,900  | 日本駐車場開発         | 73.7  | 78.1  | 10,855  | 藤田観光          | 27      | 25      | 8,975     | KNT-CTホールディング | 33    | 37    | 4,329   |              |      |      |        |
| 京都銀行         | 105     | 107     | 80,143    | 三重交通グループHD     | —     | 14.7  | 5,615   | ビューリック          | 115   | 120   | 118,440 | KNT-CTホールディング | 33      | 37      | 4,329     | 日本管財          | 4     | 6.2   | 9,399   |              |      |      |        |
| 紀陽銀行         | 21.9    | 21.7    | 34,155    | 日本商業開発         | 1     | —     | —       | 中国銀行            | 37.4  | 37.8  | 46,645  | ビューリック        | 115     | 120     | 118,440   | トーカイ          | 3.3   | 3.1   | 10,168  |              |      |      |        |
| 三重銀行         | 39      | 28      | 5,796     | プレサンスコーポレーション  | 2.5   | 2.3   | 9,729   | 鳥取銀行            | —     | 34    | 5,712   | 中国銀行          | 37.4    | 37.8    | 46,645    | セコム           | 57.3  | 63.4  | 481,586 |              |      |      |        |
| ほくほくフィナンシャルG | 365     | 370     | 52,170    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 伊予銀行            | 58.3  | 55.8  | 35,265  | 鳥取銀行          | —       | 34      | 5,712     | セコム           | 57.3  | 63.4  | 481,586 |              |      |      |        |
| 広島銀行         | 160     | 165     | 68,970    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 百十四銀行           | 62    | 60    | 18,480  | 伊予銀行          | 58.3    | 55.8    | 35,265    | セコム           | 57.3  | 63.4  | 481,586 |              |      |      |        |
| 山陰合同銀行       | 35      | 34      | 23,800    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 四国銀行            | 50    | 46    | 10,028  | 百十四銀行         | 62      | 60      | 18,480    | 丹青社           | 12.6  | 13.6  | 9,846   |              |      |      |        |
| 中国銀行         | 37.4    | 37.8    | 46,645    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 阿波銀行            | 43    | 44    | 28,116  | 四国銀行          | 50      | 46      | 10,028    | メイテック         | 8.5   | 7.8   | 27,378  |              |      |      |        |
| 鳥取銀行         | —       | 34      | 5,712     | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 鹿兒島銀行           | 38    | —     | —       | 阿波銀行          | 43      | 44      | 28,116    | アサツー ディ・ケイ    | 11.5  | 10.7  | 27,338  |              |      |      |        |
| 伊予銀行         | 58.3    | 55.8    | 35,265    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 大分銀行            | 36    | 33    | 11,715  | みずほフィナンシャルG   | 7,840.3 | 8,180.9 | 1,425,112 | 応用地質          | 7.4   | 7.4   | 7,666   |              |      |      |        |
| 百十四銀行        | 62      | 60      | 18,480    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 宮崎銀行            | 42    | 39    | 10,530  | 高知銀行          | —       | 107     | 11,556    | 船井総研ホールディン    | 8.7   | 9.9   | 14,384  |              |      |      |        |
| 四国銀行         | 50      | 46      | 10,028    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 肥後銀行            | 47    | —     | —       | 山口フィナンシャルG    | 54      | 51      | 54,468    | ペネッセホールディング   | 20.9  | 20    | 52,600  |              |      |      |        |
| 阿波銀行         | 43      | 44      | 28,116    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 佐賀銀行            | 44    | 38    | 9,310   | 長野銀行          | —       | 33      | 6,468     | イオンディライト      | 6.2   | 6.2   | 18,438  |              |      |      |        |
| 鹿兒島銀行        | 38      | —       | —         | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 十八銀行            | 41    | 37    | 11,396  | 名古屋銀行         | 52      | 48      | 16,896    | ナック           | 5.7   | —     | —       |              |      |      |        |
| 大分銀行         | 36      | 33      | 11,715    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 伊予銀行            | 58.3  | 55.8  | 35,265  | 北洋銀行          | 80.1    | 82.5    | 29,535    | ニチイ学館         | 13.6  | 12    | 9,300   |              |      |      |        |
| 宮崎銀行         | 42      | 39      | 10,530    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 百十四銀行           | 62    | 60    | 18,480  | ダイセキ          | 10.6    | 12.1    | 22,288    | —             | —     | —     |         |              |      |      |        |
| 肥後銀行         | 47      | —       | —         | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 四国銀行            | 50    | 46    | 10,028  | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 佐賀銀行         | 44      | 38      | 9,310     | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 阿波銀行            | 43    | 44    | 28,116  | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 十八銀行         | 41      | 37      | 11,396    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 鹿兒島銀行           | 38    | —     | —       | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 沖繩銀行         | 4.5     | 5.5     | 16,555    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 大分銀行            | 36    | 33    | 11,715  | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 琉球銀行         | 12.7    | 12.5    | 14,937    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 宮崎銀行            | 42    | 39    | 10,530  | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| セブン銀行        | 187     | 208.7   | 71,166    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 肥後銀行            | 47    | —     | —       | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| みずほフィナンシャルG  | 7,840.3 | 8,180.9 | 1,425,112 | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 佐賀銀行            | 44    | 38    | 9,310   | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 高知銀行         | —       | 107     | 11,556    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 十八銀行            | 41    | 37    | 11,396  | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 山口フィナンシャルG   | 54      | 51      | 54,468    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 伊予銀行            | 58.3  | 55.8  | 35,265  | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 長野銀行         | —       | 33      | 6,468     | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 百十四銀行           | 62    | 60    | 18,480  | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 名古屋銀行        | 52      | 48      | 16,896    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 四国銀行            | 50    | 46    | 10,028  | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 北洋銀行         | 80.1    | 82.5    | 29,535    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 阿波銀行            | 43    | 44    | 28,116  | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 愛知銀行         | 2.4     | 2.1     | 10,731    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 鹿兒島銀行           | 38    | —     | —       | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 第三銀行         | 45      | 39      | 6,825     | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 大分銀行            | 36    | 33    | 11,715  | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 中京銀行         | —       | 27      | 6,453     | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 宮崎銀行            | 42    | 39    | 10,530  | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 東日本銀行        | 30      | —       | —         | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 肥後銀行            | 47    | —     | —       | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 大光銀行         | 34      | 28      | 6,076     | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 佐賀銀行            | 44    | 38    | 9,310   | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| 愛媛銀行         | 37      | 31      | 7,967     | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 十八銀行            | 41    | 37    | 11,396  | —             | —       | —       | —         | —             | —     |       |         |              |      |      |        |
| トマト銀行        | 46      | 85      | 13,005    | ユニゾンホールディング    | 2.6   | 4.1   | 11,496  | 伊予銀行            | 58.3  | 55.8  | 35,265  |               |         |         |           |               |       |       |         |              |      |      |        |

## ■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<br>2,980,000<br>(1,418,700) | 株<br>(<br>—) |

(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<br>113,492,368 | %<br>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。<br>（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。<br>（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<br>(ベンチマーク) |                | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 純資産<br>総額 |              |
|------------------|-------------|-----------|--------------------|----------------|------------|------------|-----------|--------------|
|                  | 税込み<br>分配金  | 期中<br>騰落率 | 期中<br>騰落率          |                |            |            |           |              |
| 1 期末(2017年6月15日) | 円<br>12,007 | 円<br>0    | %<br>20.1          | 円<br>19,831.82 | %<br>18.4  | %<br>98.2  | %<br>1.8  | 百万円<br>3,303 |

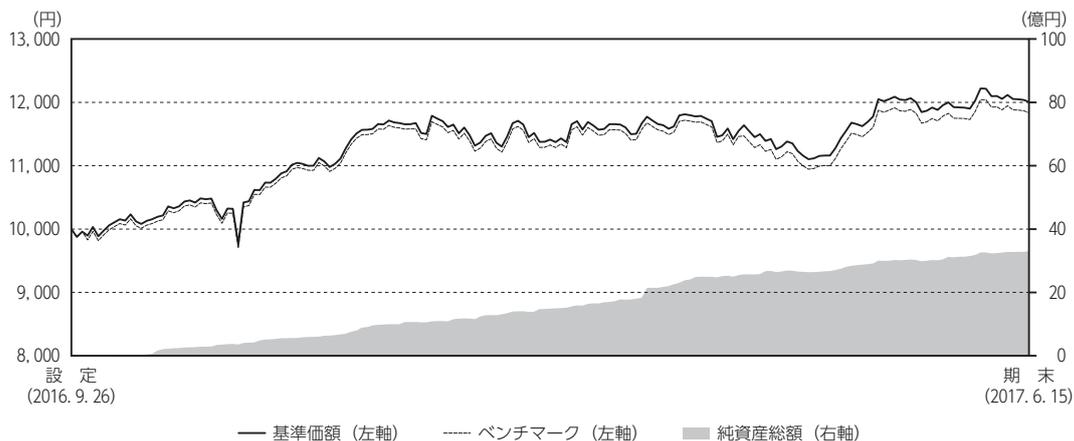
(注1) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 |
|------------------|---------|-------|------------------|-------|-------------|-------------|
|                  | 円       | 騰 落 率 | (ベンチマーク)<br>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。

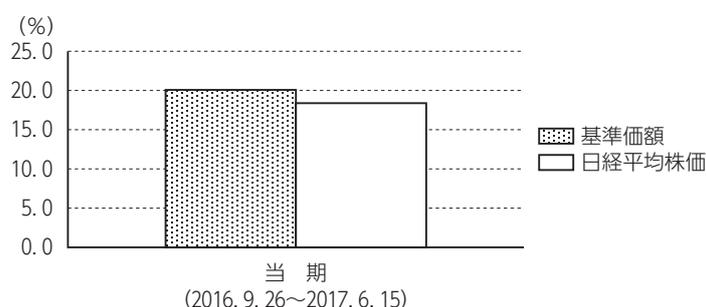
ほぼ100%組み入れているマザーファンドに組入銘柄の配当金が計上されたのに対し、ベンチマークである日経平均株価には配当金の影響が考慮されていないことが、プラスのかい離要因となりました。

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<br>～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<br>(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<br>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<br>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<br>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<br>千口 | 3,137,010<br>千円 | 6,654<br>千口 | 15,405<br>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<br>A    | うち利害<br>関係人との<br>取引状況B | B/A       | 売付額等<br>C     | うち利害<br>関係人との<br>取引状況D | D/C       |
| 株式      | 百万円<br>4,963 | 百万円<br>2,984           | %<br>60.1 | 百万円<br>51,356 | 百万円<br>18,047          | %<br>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<br>4              | 百万円<br>71 | 百万円<br>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<br>1 | 百万円<br>— | 百万円<br>1 | 百万円<br>— | 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<br>千口 | 3,302,635<br>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<br>千円 | 99.8<br>% |
| 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        |
| <b>水産・農林業 (0.2%)</b> |              |           | 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   | <b>ガラス・土石製品 (1.5%)</b> |              |           |
| マルハニチロ               | 25.8         | 81,399    | <b>化学 (8.9%)</b>      |              |           | 旭硝子                    | 258          | 241,230   |
| <b>鉱業 (0.1%)</b>     |              |           | 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   |
| <b>建設業 (2.9%)</b>    |              |           | 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   | <b>鉄鋼 (0.2%)</b>       |              |           |
| 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    |
| <b>食料品 (5.4%)</b>    |              |           | 花王                    | 258          | 1,776,846 | <b>非鉄金属 (1.3%)</b>     |              |           |
| 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   | <b>医薬品 (7.6%)</b>     |              |           | 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 | <b>金属製品 (0.4%)</b>     |              |           |
| <b>繊維製品 (0.3%)</b>   |              |           | 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    | <b>石油・石炭製品 (0.3%)</b> |              |           | <b>機械 (5.1%)</b>       |              |           |
| 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   |
| <b>パルプ・紙 (0.3%)</b>  |              |           | <b>ゴム製品 (1.1%)</b>    |              |           | 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   | <b>保険業 (1.1%)</b>    |              |           |             |
| 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   | <b>陸運業 (2.3%)</b>        |              |           | 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   | <b>その他金融業 (0.4%)</b> |              |           |             |
| 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   | <b>不動産業 (1.9%)</b>   |              |           |             |
| <b>電気機器 (18.2%)</b>  |              |           | 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   | <b>海運業 (0.2%)</b>        |              |           | 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    | <b>サービス業 (3.2%)</b>  |              |           |             |
| 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   | <b>空運業 (0.1%)</b>        |              |           | 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   | <b>倉庫・運輸関連業 (0.3%)</b>   |              |           | 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   | <b>情報・通信業 (12.4%)</b>    |              |           |                      | 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 | <b>卸売業 (2.1%)</b>        |              |           |                      |              |           |             |
| 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   |                      |              |           |             |
| <b>輸送用機器 (6.2%)</b>  |              |           | 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    | <b>小売業 (10.5%)</b>       |              |           |                      |              |           |             |
| 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 | <b>銀行業 (1.0%)</b>        |              |           |                      |              |           |             |
| 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    |                      |              |           |             |
| <b>精密機器 (2.9%)</b>   |              |           | 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   |                      |              |           |             |
| <b>その他製品 (1.2%)</b>  |              |           | 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    |                      |              |           |             |
| <b>電気・ガス業 (0.3%)</b> |              |           | <b>証券・商品先物取引業 (0.4%)</b> |              |           |                      |              |           |             |
| 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。<br>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。<br>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  |

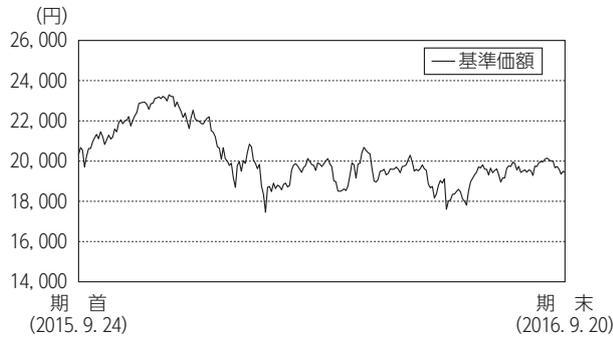
## 大和投資信託

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まいります。

#### ◆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 |   | 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<br>23,133.6<br>(△1,508.092) | 千円<br>49,619,436<br>( ) | 千株<br>10,776.008 | 千円<br>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<br>株式先物取引 | 百万円<br>43,459 | 百万円<br>43,434 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

(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   |           |        | 期 付 |           |        |
|----------------|-------|-----------|--------|-----|-----------|--------|
|                | 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    | 106   | 3,979,738 | 37,544 | 48  | 1,840,444 | 38,342 |
| ユニー・ファミリーマートHD | 309.5 | 2,428,896 | 7,847  | 144 | 922,080   | 6,403  |
| ファナック          | 106   | 1,922,373 | 18,135 | 48  | 909,361   | 18,945 |
| KDDI           | 636   | 1,870,986 | 2,941  | 288 | 892,842   | 3,100  |
| ソフトバンクグループ     | 318   | 1,760,824 | 5,537  | 96  | 516,324   | 5,378  |
| 京セラ            | 212   | 1,091,417 | 5,148  | 48  | 430,141   | 8,961  |
| アステラス製薬        | 530   | 851,538   | 1,606  | 240 | 396,842   | 1,653  |
| ダイキン工業         | 106   | 835,362   | 7,880  | 48  | 396,667   | 8,263  |
| セコム            | 106   | 833,015   | 7,858  | 96  | 395,509   | 4,119  |
| テルモ            | 212   | 800,932   | 3,777  | 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 | 日本電気硝子         | 441   | 528  |
| 鉱業 (0.1%)      |       |       |           | 旭化成             | 294   | 352   | 281,388   | 住友大阪セメント     | 294  | 352   | 162,624 | 住友大阪セメント       | 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    | 太平洋セメント      | 294  | 352   | 102,784 | 太平洋セメント        | 294   | 352  |
| 建設業 (2.8%)     |       |       |           | 住友化学            | 294   | 352   | 161,216   | 東海カーボン       | 294  | 352   | 97,856  | 東海カーボン         | 294   | 352  |
| 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 | TOTO         | 294  | 176   | 667,920 | TOTO           | 294   | 176  |
| 大成建設           | 294   | 352   | 267,520   | 日本曹達            | 294   | 352   | 148,544   | 日本碍子         | 294  | 352   | 743,776 | 日本碍子           | 294   | 352  |
| 大林組            | 294   | 352   | 347,072   | 東ソー             | 294   | 352   | 216,480   | 鉄鋼 (0.2%)    |      |       |         | 新日鐵住金          | 294   | 35.2 |
| 清水建設           | 294   | 352   | 313,280   | トクヤマ            | 294   | 352   | 121,792   | 神戸製鋼所        | 294  | 352   | 31,680  | 新日鐵住金          | 294   | 35.2 |
| 長谷工コーポレーション    | —     | 70.4  | 65,964    | デンカ             | 294   | 352   | 158,752   | JFEホールディングス  | 29.4 | 35.2  | 50,793  | 神戸製鋼所          | 294   | 352  |
| 鹿島建設           | 294   | 352   | 245,696   | 信越化学            | 294   | 352   | 2,474,560 | 日新製鋼         | 29.4 | 35.2  | 46,076  | JFEホールディングス    | 29.4  | 35.2 |
| 大和ハウス          | 294   | 352   | 936,144   | 三井化学            | 294   | 352   | 164,032   | 大平洋金属        | 294  | 352   | 100,320 | 日新製鋼           | 29.4  | 35.2 |
| 積水ハウス          | 294   | 352   | 588,720   | 三菱ケミカル HLDGS    | 147   | 176   | 106,761   | 非鉄金属 (1.3%)  |      |       |         | 日本軽金属HD        | 294   | 352  |
| 日揮             | 294   | 352   | 594,528   | 宇部興産            | 294   | 352   | 67,232    | 三井金属         | 294  | 352   | 72,864  | 日本軽金属HD        | 294   | 352  |
| 千代田化工建         | 294   | 352   | 280,896   | 日本化薬            | 294   | 352   | 373,824   | 東邦亜鉛         | 294  | 352   | 110,176 | 三井金属           | 294   | 352  |
| 食料品 (5.4%)     |       |       |           | 花王              | 294   | 352   | 1,992,320 | 三菱マテリアル      | 294  | 352   | 99,968  | 東邦亜鉛           | 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 | 住友鉱山         | 294  | 352   | 457,600 | 三菱マテリアル        | 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   | DOWAホールディングス | 294  | 352   | 241,824 | 住友鉱山           | 294   | 352  |
| 日本ハム           | 294   | 352   | 853,600   | 日東電工            | 294   | 352   | 2,330,944 | 古河機金         | 294  | 352   | 55,264  | DOWAホールディングス   | 294   | 352  |
| サッポロホールディングス   | 294   | 70.4  | 193,036   | 医薬品 (7.7%)      |       |       |           | 古河電工         | 294  | 352   | 90,816  | サッポロホールディングス   | 294   | 70.4 |
| 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   | 住友電工         | 294  | 352   | 506,704 | アサヒグループホールディング | 294   | 352  |
| キリンHD          | 294   | 352   | 573,584   | 武田薬品            | 294   | 352   | 1,634,688 | フジクラ         | 294  | 352   | 196,416 | キリンHD          | 294   | 352  |
| 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 | 金属製品 (0.4%)  |      |       |         | SUMCO          | 29.4  | 35.2 |
| キッコーマン         | 294   | 352   | 1,126,400 | 大日本住友製薬         | 294   | 352   | 630,432   | 東洋製罐グループHD   | 294  | 352   | 647,680 | SUMCO          | 29.4  | 35.2 |
| 味の素            | 294   | 352   | 782,848   | 塩野義製薬           | 294   | 352   | 1,763,520 | 機械 (5.2%)    |      |       |         | 日本製鋼所          | 294   | 352  |
| ニチレイ           | 294   | 352   | 373,472   | 中外製薬            | 294   | 352   | 1,226,720 | オークマ         | 294  | 352   | 266,112 | 日本製鋼所          | 294   | 352  |
| 日本たばこ産業        | 294   | 352   | 1,396,032 | エーザイ            | 294   | 352   | 2,244,704 | アマダホールディングス  | 294  | 352   | 375,936 | オークマ           | 294   | 352  |
| 繊維製品 (0.4%)    |       |       |           | 第一三共            | 294   | 352   | 850,608   | 小松製作所        | 294  | 352   | 805,552 | アマダホールディングス    | 294   | 352  |
| 東洋紡            | 294   | 352   | 57,728    | 石油・石炭製品 (0.3%)  |       |       |           | 住友重機械        | 294  | 352   | 177,408 | 小松製作所          | 294   | 352  |
| ユニチカ           | 294   | 352   | 19,712    | 昭和シエル石油         | 294   | 352   | 312,224   | 日立建機         | 294  | 352   | 696,608 | 住友重機械          | 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   | クボタ          | 294  | 352   | 516,032 | 日立建機           | 294   | 352  |
| 帝人             | 294   | 352   | 138,688   | ゴム製品 (1.0%)     |       |       |           | 荏原製作所        | 294  | 352   | 195,008 | クボタ            | 294   | 352  |
| 東レ             | 294   | 352   | 338,870   | 横浜ゴム            | 147   | 176   | 287,408   |              |      |       |         | 荏原製作所          | 294   | 352  |
| パルプ・紙 (0.3%)   |       |       |           | ブリヂストン          | 294   | 352   | 1,277,056 |              |      |       |         |                |       |      |
| 王子ホールディングス     | 294   | 352   | 142,208   | ガラス・土石製品 (1.5%) |       |       |           |              |      |       |         |                |       |      |
| 日本製紙           | 29.4  | 35.2  | 65,296    | 日東紡績            | 294   | —     | —         |              |      |       |         |                |       |      |

| 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 | <b>その他製品 (1.2%)</b>    |       |       |       |     | 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 | <b>銀行業 (1.0%)</b>                  |       |          |         |     |    |
| 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 | <b>電気・ガス業 (0.3%)</b>   |       |       |       |     | 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 |    |
| <b>電気機器 (16.9%)</b> |      |      |       |     | 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 | <b>陸運業 (2.5%)</b>      |       |       |       |     | 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 | <b>証券・商品先物取引業 (0.5%)</b>           |       |          |         |     |    |
| 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 | <b>保険業 (1.0%)</b>                  |       |          |         |     |    |
| 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 | <b>海運業 (0.2%)</b>      |       |       |       |     | 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 | <b>空運業 (0.1%)</b>      |       |       |       |     | <b>その他金融業 (0.4%)</b>               |       |          |         |     |    |
| 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 | <b>倉庫・運輸関連業 (0.4%)</b> |       |       |       |     | <b>不動産業 (1.8%)</b>                 |       |          |         |     |    |
| 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 | ヤフー                    | 117.6 | 140.8 | 57    | 587 | 三井不動産                              | 294   | 352      | 730     | 928 |    |
| カシオ                 | 294  | 352  | 495   | 264 | トレンドマイクロ               | 294   | 352   | 1,244 | 320 | 三菱地所                               | 294   | 352      | 659     | 296 |    |
| ファナック               | 294  | 352  | 5,954 | 080 | スカパー JSA THD           | 29.4  | 35.2  | 16    | 684 | 平和不動産                              | 58.8  | —        | —       | —   |    |
| 京セラ                 | 588  | 704  | 3,510 | 144 | ANAホールディングス            | 29.4  | 35.2  | 324   | 825 | 東京建物                               | 147   | 176      | 213     | 664 |    |
| 太陽誘電                | 294  | 352  | 362   | 560 | KDDI                   | 1,764 | 2,112 | 6,477 | 504 | 住友不動産                              | 294   | 352      | 917     | 136 |    |
| SCREENホールディングス      | 294  | 352  | 441   | 408 | NTTドコモ                 | 29.4  | 35.2  | 90    | 076 | <b>サービス業 (3.4%)</b>                |       |          |         |     |    |
| キャノン                | 441  | 528  | 1,532 | 256 | 東宝                     | 29.4  | 35.2  | 116   | 864 | ディー・エヌ・エー                          | —     | 105.6    | 403     | 392 |    |
| リコー                 | 294  | 352  | 325   | 248 | NTTデータ                 | 294   | 352   | 1,833 | 920 | 電通                                 | 294   | 352      | 1,869   | 120 |    |
| 東京エレクトロン            | 294  | 352  | 3,229 | 248 | コナミホールディングス            | 294   | 352   | 1,346 | 400 | 東京ドーム                              | 294   | 176      | 172     | 480 |    |
| <b>輸送用機器 (6.7%)</b> |      |      |       |     | ソフトバンクグループ             | 882   | 1,056 | 6,839 | 712 | セコム                                | 294   | 352      | 2,673   | 792 |    |
| デンソー                | 294  | 352  | 1,456 | 224 | <b>卸売業 (2.0%)</b>      |       |       |       |     | 合計                                 | 株数、金額 | 62,489.7 | 千株      | 千株  | 千円 |
| 三井造船                | 294  | 352  | 49    | 632 | 双日                     | 29.4  | 35.2  | 8     | 905 | 銘柄数<比率>                            | 225銘柄 | 225銘柄    | <98.6%> |     |    |
| 川崎重工業               | 294  | 352  | 109   | 120 | 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。 |       |          |         |     |    |
| 日産自動車               | 294  | 352  | 355   | 168 | 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。    |       |          |         |     |    |
| いすゞ自動車              | 147  | 176  | 215   | 424 | 豊田通商                   | 294   | 352   | 835   | 296 | (注3) 評価額の単位未満は切捨て。                 |       |          |         |     |    |
| トヨタ自動車              | 294  | 352  | 2,095 | 104 | 三井物産                   | 294   | 352   | 472   | 912 | <b>(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)</b>      |       |          |         |     |    |
| 日野自動車               | 294  | 352  | 383   | 680 | 住友商事                   | 294   | 352   | 392   | 128 | 銘柄別                                | 当期末   |          |         |     |    |
| 三菱自動車工業             | 29.4 | 35.2 | 16    | 192 | 三菱商事                   | 294   | 352   | 747   | 648 | 買建額                                | 売建額   |          |         |     |    |
| マツダ                 | 58.8 | 70.4 | 111   | 302 | <b>小売業 (11.5%)</b>     |       |       |       |     | 国内                                 | 百万円   | 百万円      |         |     |    |
| 本田技研                | 588  | 704  | 2,084 | 544 | J.フロントリテイリング           | 147   | 176   | 224   | 576 | 日経平均                               | 2,170 | —        |         |     |    |
| スズキ                 | 294  | 352  | 1,180 | 960 | 三越伊勢丹HD                | 294   | 352   | 362   | 560 | (注) 単位未満は切捨て。                      |       |          |         |     |    |
| 富士重工業               | 294  | 352  | 1,342 | 880 | セブン&アイ・HLDGS           | 294   | 352   | 1,600 | 192 |                                    |       |          |         |     |    |
| ヤマハ発動機              | —    | 352  | 691   | 328 | ユニー・ファミリーマートHD         | —     | 352   | 2,386 | 560 |                                    |       |          |         |     |    |
| <b>精密機器 (3.1%)</b>  |      |      |       |     | 高島屋                    | 294   | 352   | 288   | 288 |                                    |       |          |         |     |    |
| テルモ                 | 588  | 704  | 2,759 | 680 | 丸井グループ                 | 294   | 352   | 496   | 672 |                                    |       |          |         |     |    |
| ニコン                 | 294  | 352  | 525   | 888 | イオン                    | 294   | 352   | 524   | 480 |                                    |       |          |         |     |    |
| オリンパス               | 294  | 352  | 1,265 | 440 | ユニーグループ・HD             | 294   | —     | —     | —   |                                    |       |          |         |     |    |
| シチズンホールディングス        | 294  | 352  | 188   | 672 |                        |       |       |       |     |                                    |       |          |         |     |    |

■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                   |
|--------------------------|-------------------------|
| <b>(A) 資産</b>            | <b>155,558,837,911円</b> |
| 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>(B) 負債</b>            | <b>2,407,962,940</b>    |
| 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             |
| <b>(C) 純資産総額 (A - B)</b> | <b>153,150,874,971</b>  |
| 元本                       | 78,725,801,897          |
| 次期繰越損益金                  | 74,425,073,074          |
| <b>(D) 受益権総口数</b>        | <b>78,725,801,897口</b>  |
| 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                     |
|----------------------------------|-------------------------|
| <b>(A) 配当等収益</b>                 | <b>2,886,934,761円</b>   |
| 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>(B) 有価証券売買損益</b>              | <b>△ 8,179,590,699</b>  |
| 売買益                              | 9,210,763,785           |
| 売買損                              | △ 17,390,354,484        |
| <b>(C) 先物取引等損益</b>               | <b>16,773,226</b>       |
| 取引益                              | 917,419,699             |
| 取引損                              | △ 900,646,473           |
| <b>(D) その他費用</b>                 | <b>△ 32,022</b>         |
| <b>(E) 当期損益金 (A + B + C + D)</b> | <b>△ 5,275,914,734</b>  |
| <b>(F) 前期繰越損益金</b>               | <b>67,926,219,578</b>   |
| <b>(G) 解約差損益金</b>                | <b>△ 15,963,007,117</b> |
| <b>(H) 追加信託差損益金</b>              | <b>27,737,775,347</b>   |
| <b>(I) 合計 (E + F + G + H)</b>    | <b>74,425,073,074</b>   |
| 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<br>(円ヘッジ・ベース) |             | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>受益証券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |               |
|-----------------|-------------|-----------|--------------------------|-------------|------------|------------|----------------------|--------------------|-----------|---------------|
|                 | 税込み<br>分配金  | 期中<br>騰落率 | (ベンチマーク)                 | 期中<br>騰落率   |            |            |                      |                    |           |               |
| 1期末(2017年6月15日) | 円<br>11,194 | 円<br>0    | %<br>11.9                | 円<br>11,071 | %<br>10.7  | %<br>93.4  | %<br>3.8             | %<br>0.0           | %<br>2.4  | 百万円<br>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。

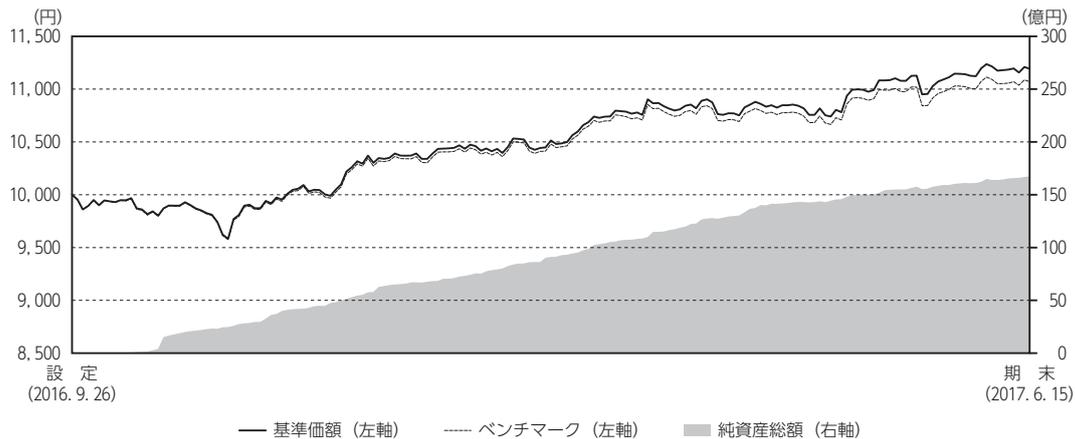
(注3) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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<br>(円ヘッジ・ベース) |       | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 投資信託<br>受益証券<br>組入比率 | 投資信託<br>証 券<br>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)<br>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

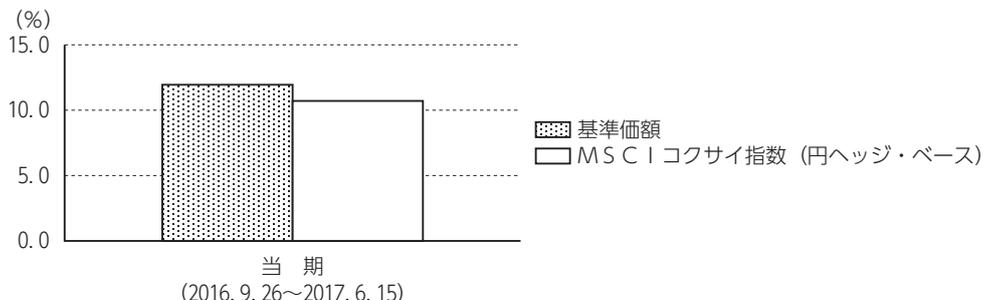
ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式（リート、株式先物を含む。）のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで、基準価額とベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース））との連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

## 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<br>~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<br>(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<br>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<br>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<br>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<br>千口 | 15,672,999<br>千円 | 74,914<br>千口 | 126,200<br>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<br>百万円 | —<br>百万円 | 1<br>百万円 | —<br>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<br>千口 | 16,736,897<br>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<br>為替ヘッジ型マザーファンド | 16,736,897<br>千円 | 99.7<br>% |
| 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<br>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         |
| VERESIN 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<br>銘柄数 < 比率 > | 2,383.08<br>87銘柄 | 9,804<br>812,657 | <3.7%>     |
|                              | 百株                  | 千オーストラリア・ドル      | 千円               |            |
| <b>(オーストラリア)</b>             |                     |                  |                  |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 4,320.78<br>57銘柄 | 6,957<br>579,400 | <2.7%>     |
|                              | 百株                  | 千香港ドル            | 千円               |            |
| <b>(香港)</b>                  |                     |                  |                  |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 5,694.59<br>35銘柄 | 19,352<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 2,659<br>19銘柄    | 1,390<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 418.6<br>4銘柄     | 177<br><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<br>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・シケル通貨計                 | 株数、金額<br>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<br>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<br>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              |              | 千円                |            |
|                              |                     | 外貨建金額            | 邦貨換算金額       |                   |            |
| YARA INTERNATIONAL ASA       | 8.5                 | 268              | 3,499        | 千円                | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 338<br>9銘柄       | 4,087        | 53,263<br><0.2%>  |            |
| <b>(スウェーデン)</b>              |                     | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 1,341.78<br>28銘柄 | 19,305       | 243,443<br><1.1%> |            |
| <b>ユーロ (アイルランド)</b>          |                     | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 1,626.6<br>4銘柄   | 291          | 35,914<br><0.2%>  |            |
| <b>ユーロ (オランダ)</b>            |                     | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 1,250.17<br>27銘柄 | 2,797        | 344,344<br><1.6%> |            |
| <b>ユーロ (ベルギー)</b>            |                     | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 103.98<br>10銘柄 | 803<br><0.5%> |            |
|                              | 百株                  | 千ユーロ           | 千円            |            |
| <b>ユーロ (ルクセンブルグ)</b>         |                     |                |               |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 88.54<br>5銘柄   | 206<br><0.1%> |            |
|                              | 百株                  | 千ユーロ           | 千円            |            |
| <b>ユーロ (フランス)</b>            |                     |                |               |            |
| 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   |         |            |
| 株数、金額                        |  |              | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
| 国小計                          |  | 銘柄数 < 比率 >   |       |         |            |
| 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 |            |
| 国小計                          |  | 64銘柄         |       | <3.7%>  |            |
| 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 |            |
| 国小計                          |  | 54銘柄         |       | <3.7%>  |            |
| 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  |            |
| 国小計                          |  | 3銘柄          |       | <0.1%>  |            |
| 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   |

| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 2,950.72<br>25銘柄     | 2,397<br><1.4%>   | 295,153    |            |
|                              | 百株                  | 千ユーロ                 | 千円                |            |            |
| <b>ユーロ (イタリア)</b>            |                     |                      |                   |            |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 3,029.55<br>17銘柄     | 1,335<br><0.8%>   | 164,373    |            |
|                              | 百株                  | 千ユーロ                 | 千円                |            |            |
| <b>ユーロ (フィンランド)</b>          |                     |                      |                   |            |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 484.43<br>12銘柄       | 712<br><0.4%>     | 87,715     |            |
|                              | 百株                  | 千ユーロ                 | 千円                |            |            |
| <b>ユーロ (オーストリア)</b>          |                     |                      |                   |            |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 39.5<br>4銘柄          | 154<br><0.1%>     | 19,021     |            |
|                              | 百株                  | 千ユーロ                 | 千円                |            |            |
| <b>ユーロ (その他)</b>             |                     |                      |                   |            |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 45<br>2銘柄            | 91<br><0.1%>      | 11,293     |            |
| ユーロ通貨計                       | 株数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 12,670.95<br>227銘柄   | 22,060<br><12.5%> | 2,715,854  |            |
| ファンド合計                       | 株数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 65,624.52<br>1,231銘柄 | —<br><93.4%>      | 20,378,537 |            |

(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<br>銘柄数 < 比率 > | 29<br>1銘柄    | 3,264<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 3,796<br>39銘柄 | 416,584<br><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<br>銘柄数 < 比率 >    | 35<br>1銘柄     | 2,913<br><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<br>銘柄数 < 比率 >  | 593<br>8銘柄    | 49,410<br><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。<br>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。<br>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  |

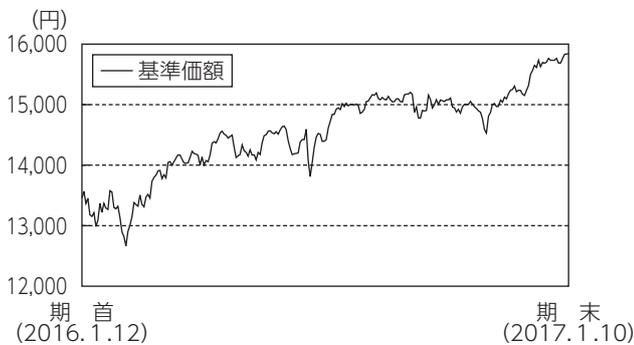
## 大和投資信託

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まいります。

#### ◆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まいります。

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

(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<br>(株式) | 5円<br>(5)  |
| (先物)            | (1)        |
| (投資信託証券)        | (0)        |
| 有価証券取引税<br>(株式) | 6<br>(6)   |
| (投資信託証券)        | (0)        |
| その他費用<br>(保管費用) | 21<br>(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<br>5,623.95<br>(△ 44.68) | 千アメリカ・ドル<br>34,844<br>(△ 537)  | 百株          | 千アメリカ・ドル<br>2,590     | 百株          | 千アメリカ・ドル<br>2,590     |    |
|                 | カナダ                        | 百株<br>912.5<br>( 3.95)      | 千カナダ・ドル<br>3,559<br>( )        | 百株          | 千カナダ・ドル<br>753        | 百株          | 千カナダ・ドル<br>753        |    |
|                 | オーストラリア                    | 百株<br>1,703.5<br>(△ 10.83)  | 千オーストラリア・ドル<br>2,365<br>(△ 18) | 百株          | 千オーストラリア・ドル<br>394    | 百株          | 千オーストラリア・ドル<br>394    |    |
|                 | 香港                         | 百株<br>1,911<br>( 19.21)     | 千香港ドル<br>6,638<br>( )          | 百株          | 千香港ドル<br>1,556        | 百株          | 千香港ドル<br>1,556        |    |
|                 | シンガポール                     | 百株<br>1,187<br>( )          | 千シンガポール・ドル<br>445<br>(△ 0)     | 百株          | 千シンガポール・ドル<br>70      | 百株          | 千シンガポール・ドル<br>70      |    |
|                 | ニュージーランド                   | 百株<br>181<br>( )            | 千ニュージーランド・ドル<br>59<br>( )      | 百株          | 千ニュージーランド・ドル<br>21    | 百株          | 千ニュージーランド・ドル<br>21    |    |
|                 | イギリス                       | 百株<br>5,342.5<br>(△ 68.45)  | 千イギリス・ポンド<br>2,954<br>(△ 85)   | 百株          | 千イギリス・ポンド<br>19       | 百株          | 千イギリス・ポンド<br>19       |    |
|                 | イスラエル                      | 百株<br>42<br>( )             | 千イスラエル・シケル<br>275<br>( )       | 百株          | 千イスラエル・シケル<br>320     | 百株          | 千イスラエル・シケル<br>320     |    |
|                 | スイス                        | 百株<br>361.8<br>( )          | 千スイス・フラン<br>2,302<br>(△ 18)    | 百株          | 千スイス・フラン<br>427       | 百株          | 千スイス・フラン<br>427       |    |
|                 | デンマーク                      | 百株<br>91.16<br>( )          | 千デンマーク・クローネ<br>3,053<br>( )    | 百株          | 千デンマーク・クローネ<br>438    | 百株          | 千デンマーク・クローネ<br>438    |    |
|                 | ノルウェー                      | 百株<br>107.5<br>( )          | 千ノルウェー・クローネ<br>1,518<br>(△ 1)  | 百株          | 千ノルウェー・クローネ<br>220    | 百株          | 千ノルウェー・クローネ<br>220    |    |
|                 | スウェーデン                     | 百株<br>621<br>( )            | 千スウェーデン・クローネ<br>7,565<br>(△ 9) | 百株          | 千スウェーデン・クローネ<br>1,874 | 百株          | 千スウェーデン・クローネ<br>1,874 |    |
|                 | ユーロ<br>(アイルランド)            | 百株<br>1,317<br>( )          | 千ユーロ<br>107<br>( )             | 百株          | 千ユーロ<br>-             | 百株          | 千ユーロ<br>-             |    |
|                 | ユーロ<br>(オランダ)              | 百株<br>339<br>( 6.51)        | 千ユーロ<br>686<br>(△ 2)           | 百株          | 千ユーロ<br>46            | 百株          | 千ユーロ<br>46            |    |
|                 | ユーロ<br>(ベルギー)              | 百株<br>35.5<br>(△ 1.5)       | 千ユーロ<br>268<br>( )             | 百株          | 千ユーロ<br>27            | 百株          | 千ユーロ<br>27            |    |
|                 | ユーロ<br>(ルクセンブルグ)           | 百株<br>73.6<br>( )           | 千ユーロ<br>96<br>(△ 0)            | 百株          | 千ユーロ<br>-             | 百株          | 千ユーロ<br>-             |    |
|                 | ユーロ<br>(フランス)              | 百株<br>420.9<br>( 2.64)      | 千ユーロ<br>1,753<br>( )           | 百株          | 千ユーロ<br>28            | 百株          | 千ユーロ<br>28            |    |
|                 | ユーロ<br>(ドイツ)               | 百株<br>401.6<br>( 2.95)      | 千ユーロ<br>1,763<br>(△ 2)         | 百株          | 千ユーロ<br>31            | 百株          | 千ユーロ<br>31            |    |
|                 | ユーロ<br>(ポルトガル)             | 百株<br>18<br>( )             | 千ユーロ<br>22<br>( )              | 百株          | 千ユーロ<br>-             | 百株          | 千ユーロ<br>-             |    |
| ユーロ<br>(スペイン)   | 百株<br>857<br>( 138.05)     | 千ユーロ<br>604<br>( )          | 百株                             | 千ユーロ<br>15  | 百株                    | 千ユーロ<br>15  |                       |    |
| ユーロ<br>(イタリア)   | 百株<br>728.5<br>( 18.47)    | 千ユーロ<br>290<br>(△ 0)        | 百株                             | 千ユーロ<br>16  | 百株                    | 千ユーロ<br>16  |                       |    |
| ユーロ<br>(フィンランド) | 百株<br>194.5<br>( )         | 千ユーロ<br>198<br>( )          | 百株                             | 千ユーロ<br>17  | 百株                    | 千ユーロ<br>17  |                       |    |
| ユーロ<br>(オーストリア) | 百株<br>12.5<br>( )          | 千ユーロ<br>40<br>(△ 0)         | 百株                             | 千ユーロ<br>-   | 百株                    | 千ユーロ<br>-   |                       |    |
| ユーロ<br>(その他)    | 百株<br>-<br>( 5)            | 千ユーロ<br>-<br>( 15)          | 百株                             | 千ユーロ<br>-   | 百株                    | 千ユーロ<br>-   |                       |    |
| ユーロ<br>(ユーロ通貨計) | 百株<br>4,398.1<br>( 172.12) | 千ユーロ<br>5,834<br>( 15)      | 百株                             | 千ユーロ<br>183 | 百株                    | 千ユーロ<br>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<br>24.02<br>( 0.83) | 千アメリカ・ドル<br>1,215<br>( 8) | 千口<br>0.49<br>( -) | 千アメリカ・ドル<br>35<br>( -)   | 千口<br>0.49<br>( -) | 千アメリカ・ドル<br>35<br>( -)   | 千口<br>0.49<br>( -) | 千アメリカ・ドル<br>35<br>( -)   |
|   | オーストラリア       | 千口<br>40.3<br>( )      | 千オーストラリア・ドル<br>194<br>( ) | 千口<br>4.9<br>( )   | 千オーストラリア・ドル<br>25<br>( ) | 千口<br>4.9<br>( )   | 千オーストラリア・ドル<br>25<br>( ) | 千口<br>4.9<br>( )   | 千オーストラリア・ドル<br>25<br>( ) |
|   | 香港            | 千口<br>6.5<br>( )       | 千香港ドル<br>349<br>( )       | 千口<br>-<br>( )     | 千香港ドル<br>-<br>( )        | 千口<br>-<br>( )     | 千香港ドル<br>-<br>( )        | 千口<br>-<br>( )     | 千香港ドル<br>-<br>( )        |
|   | シンガポール        | 千口<br>12<br>( )        | 千シンガポール・ドル<br>29<br>(△ 0) | 千口<br>-<br>( )     | 千シンガポール・ドル<br>-<br>( )   | 千口<br>-<br>( )     | 千シンガポール・ドル<br>-<br>( )   | 千口<br>-<br>( )     | 千シンガポール・ドル<br>-<br>( )   |
|   | イギリス          | 千口<br>2.15<br>( )      | 千イギリス・ポンド<br>21<br>( )    | 千口<br>-<br>( )     | 千イギリス・ポンド<br>-<br>( )    | 千口<br>-<br>( )     | 千イギリス・ポンド<br>-<br>( )    | 千口<br>-<br>( )     | 千イギリス・ポンド<br>-<br>( )    |
|   | ユーロ<br>(フランス) | 千口<br>0.76<br>( )      | 千ユーロ<br>82<br>( )         | 千口<br>-<br>( )     | 千ユーロ<br>-<br>( )         | 千口<br>-<br>( )     | 千ユーロ<br>-<br>( )         | 千口<br>-<br>( )     | 千ユーロ<br>-<br>( )         |

(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   |
| 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                                   |      |        |        |
|----------------------------|-------|---------|--------|------|-------------------------------------|------|--------|--------|
|                            | 柄     | 株数      | 金額     | 平均単価 | 柄                                   | 株数   | 金額     | 平均単価   |
| APPLE INC (アメリカ)           | 9.6   | 118,004 | 12,292 | 円    | NESTLE SA-REG (スイス)                 | 1.7  | 13,489 | 7,934  |
| MICROSOFT CORP (アメリカ)      | 13    | 84,012  | 6,462  | 円    | HOME DEPOT INC (アメリカ)               | 0.85 | 12,087 | 14,220 |
| EXXON MOBIL CORP (アメリカ)    | 7.85  | 75,566  | 9,626  | 円    | BANK OF NOVA SCOTIA (カナダ)           | 2    | 11,173 | 5,586  |
| AMAZON.COM INC (アメリカ)      | 0.69  | 58,912  | 85,380 | 円    | CANADIAN NATL RAILWAY CO (カナダ)      | 1.5  | 10,273 | 6,849  |
| GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ) | 17.65 | 58,510  | 3,315  | 円    | GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)          | 3    | 10,012 | 3,337  |
| JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)   | 4.6   | 58,233  | 12,659 | 円    | TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD (イスラエル) | 2    | 9,409  | 4,704  |
| NESTLE SA-REG (スイス)        | 7.2   | 57,241  | 7,950  | 円    | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN (スイス)  | 0.36 | 9,356  | 25,990 |
| FACEBOOK INC-A (アメリカ)      | 4.25  | 57,091  | 13,433 | 円    | TORONTO-DOMINION BANK (カナダ)         | 1.8  | 8,748  | 4,860  |
| JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ) | 6.1   | 48,423  | 7,938  | 円    | APPLE INC (アメリカ)                    | 0.75 | 7,988  | 10,651 |
| AT&T INC (アメリカ)            | 11.2  | 48,104  | 4,295  | 円    | COMCAST CORP-CLASS A (アメリカ)         | 1.2  | 7,929  | 6,607  |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

| 銘柄                           | 期首    |        | 期末                |              | 業種等        |
|------------------------------|-------|--------|-------------------|--------------|------------|
|                              | 株数    | 株数     | 評価額               |              |            |
|                              |       |        | 外貨建金額<br>千アメリカ・ドル | 邦貨換算金額<br>千円 |            |
| (アメリカ)                       | 百株    | 百株     | 千アメリカ・ドル          | 千円           |            |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | —     | 3.5    | 23                | 2,684        | 情報技術       |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 1     | 2.5    | 33                | 3,876        | 情報技術       |
| JARDEN CORP                  | 3     | —      | —                 | —            | その他        |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC     | 1     | 1      | 11                | 1,351        | ヘルスケア      |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | 10    | 27.5   | 101               | 11,767       | 金融         |
| ABBOTT LABORATORIES          | 23    | 55.7   | 226               | 26,313       | ヘルスケア      |
| ARCONIC INC                  | 18    | 15     | 30                | 3,546        | 資本財・サービス   |
| VERISK ANALYTICS INC         | 2     | 5      | 40                | 4,738        | 資本財・サービス   |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 6     | 14     | 77                | 9,044        | 一般消費財・サービス |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 5     | 8      | 53                | 6,250        | 情報技術       |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV  | 4     | 10.5   | 81                | 9,501        | 情報技術       |
| QORVO INC                    | 2     | 2      | 10                | 1,260        | 情報技術       |
| AFLAC INC                    | 6     | 13.5   | 93                | 10,883       | 金融         |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 2     | 5      | 35                | 4,149        | 一般消費財・サービス |
| ADOBE SYSTEMS INC            | 7     | 16     | 173               | 20,143       | 情報技術       |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 2     | 11     | 37                | 4,307        | 素材         |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 2     | 2      | 13                | 1,581        | 一般消費財・サービス |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL    | 5     | 5      | 9                 | 1,117        | 金融         |
| GARMIN LTD                   | 2     | 2      | 9                 | 1,115        | 一般消費財・サービス |
| AETNA INC                    | 5.94  | 10.44  | 128               | 14,912       | ヘルスケア      |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 3     | 6.5    | 95                | 11,027       | 素材         |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 11    | 22.5   | 264               | 30,669       | 資本財・サービス   |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC    | —     | 7      | 37                | 4,334        | 情報技術       |
| WR BERKLEY CORP              | 2     | 2      | 13                | 1,529        | 金融         |
| AUTOZONE INC                 | 0.6   | 1      | 79                | 9,164        | 一般消費財・サービス |
| DOLLAR TREE INC              | 4.49  | 8.49   | 65                | 7,594        | 一般消費財・サービス |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | —     | 32     | 112               | 13,009       | ヘルスケア      |
| PINNACLE WEST CAPITAL        | —     | 5      | 38                | 4,477        | 公益事業       |
| CELANESE CORP-SERIES A       | 3     | 6      | 48                | 5,605        | 素材         |
| DR HORTON INC                | 6     | 14.5   | 40                | 4,701        | 一般消費財・サービス |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | —     | 4.5    | 22                | 2,610        | エネルギー      |
| DENTSPLY SIRONA INC          | —     | 7      | 40                | 4,746        | ヘルスケア      |
| AUTODESK INC                 | 4     | 7      | 55                | 6,460        | 情報技術       |
| MOODY'S CORP                 | 3     | 5.5    | 53                | 6,177        | 金融         |
| DEVON ENERGY CORP            | 7     | 13     | 60                | 7,021        | エネルギー      |
| ALBEMARLE CORP               | —     | 3      | 27                | 3,147        | 素材         |
| ATMOS ENERGY CORP            | —     | 3      | 21                | 2,546        | 公益事業       |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 3     | 6      | 22                | 2,593        | 公益事業       |
| CITIGROUP INC                | 43.8  | 91.8   | 552               | 64,104       | 金融         |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 6     | 14     | 143               | 16,635       | 情報技術       |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 5.5   | 16.5   | 102               | 11,922       | 公益事業       |
| ALLEGHANY CORP               | —     | 0.3    | 18                | 2,096        | 金融         |
| DUN & BRADSTREET CORP        | 1     | 1      | 12                | 1,427        | 資本財・サービス   |
| DOMINO'S PIZZA INC           | —     | 1.5    | 24                | 2,861        | 一般消費財・サービス |
| HESS CORP                    | 4     | 8.5    | 51                | 5,974        | エネルギー      |
| DAVITA INC                   | 2     | 6      | 38                | 4,409        | ヘルスケア      |
| DANAHER CORP                 | 8     | 19     | 153               | 17,755       | ヘルスケア      |
| FORTIVE CORP                 | —     | 10     | 53                | 6,230        | 資本財・サービス   |
| AVNET INC                    | —     | 4      | 18                | 2,172        | 情報技術       |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 1.85  | 18.25  | 104               | 12,066       | 金融         |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A     | 2     | 2      | 6                 | 706          | 一般消費財・サービス |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C     | —     | 2.01   | 5                 | 629          | 一般消費財・サービス |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 10    | 19.5   | 87                | 10,118       | 生活必需品      |
| BLUNGE LTD                   | 3     | 3      | 21                | 2,440        | 生活必需品      |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 5.5   | 13     | 87                | 10,146       | 情報技術       |
| APPLE INC                    | 83    | 171.5  | 2,040             | 236,637      | 情報技術       |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 6     | 14     | 100               | 11,627       | 金融         |
| BOEING CO/THE                | 9.5   | 18.5   | 292               | 33,963       | 資本財・サービス   |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 3     | 6      | 44                | 5,183        | 金融         |
| SPECTRA ENERGY CORP          | 10    | 23.5   | 99                | 11,546       | エネルギー      |
| BECTON DICKINSON AND CO      | 2.73  | 6.73   | 113               | 13,178       | ヘルスケア      |
| CDK GLOBAL INC               | —     | 6      | 36                | 4,187        | 情報技術       |
| NISOURCE INC                 | —     | 9      | 19                | 2,302        | 公益事業       |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP      | 5     | —      | —                 | —            | その他        |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 3     | 3      | 21                | 2,545        | 資本財・サービス   |
| CR BARD INC                  | 1     | 2      | 46                | 5,337        | ヘルスケア      |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 16    | 32     | 152               | 17,677       | 金融         |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 58.94 | 127.44 | 671               | 77,850       | 電気通信サービス   |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 17    | 37     | 599               | 69,515       | 金融         |
| ANSYS INC                    | —     | 2      | 18                | 2,186        | 情報技術       |
| H&R BLOCK INC                | 3     | 3      | 7                 | 820          | 一般消費財・サービス |
| BB&T CORP                    | 12    | 24.5   | 114               | 13,276       | 金融         |
| BROADCOM CORP-CL A           | 8     | —      | —                 | —            | その他        |
| BAKER HUGHES INC             | 6.81  | 13.81  | 87                | 10,127       | エネルギー      |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 24    | 52.5   | 313               | 36,363       | ヘルスケア      |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO    | 1     | 1      | 7                 | 879          | 生活必需品      |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 55    | 113    | 973               | 112,925      | 金融         |
| LEGG MASON INC               | 3     | —      | —                 | —            | 金融         |
| T. ROWE PRICE GROUP INC      | 4     | 7.5    | 54                | 6,334        | 金融         |
| CIGNA CORP                   | 3.5   | 8      | 113               | 13,205       | ヘルスケア      |
| LKQ CORP                     | 5     | 12     | 37                | 4,340        | 一般消費財・サービス |
| COMPUTER SCIENCES CORP       | —     | 5      | 29                | 3,467        | 情報技術       |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD     | —     | 2      | 27                | 3,146        | 金融         |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP | 19.21 | 19.21  | 7                 | 819          | 電気通信サービス   |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 1     | 9      | 40                | 4,670        | 生活必需品      |
| CADENCE DESIGN SYS INC       | —     | 8      | 20                | 2,385        | 情報技術       |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 3     | 5.5    | 63                | 7,347        | 金融         |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 4     | 7.5    | 55                | 6,412        | 一般消費財・サービス |
| SERVICENOW INC               | 3     | 6      | 49                | 5,705        | 情報技術       |
| CATERPILLAR INC              | 9     | 17.5   | 161               | 18,744       | 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<br>千アメリカ・ドル | 邦貨換算金額<br>千円 |            |
| (アメリカ)                       | 百株    | 百株    | 千アメリカ・ドル          | 千円           |            |
| CMS ENERGY CORP              | 5     | 11    | 45                | 5,303        | 公益事業       |
| MOSAIC CO/THE                | 7     | 7     | 21                | 2,492        | 素材         |
| DELTA AIR LINES INC          | 4     | 4     | 19                | 2,304        | 資本財・サービス   |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO    | 3     | 7     | 50                | 5,811        | 生活必需品      |
| CORNING INC                  | 21    | 31    | 75                | 8,796        | 情報技術       |
| CISCO SYSTEMS INC            | 73    | 157.5 | 475               | 55,119       | 情報技術       |
| DU PONT (E.I.) DE NEMOURS    | 13    | 26    | 191               | 22,226       | 素材         |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC    | 2     | —     | —                 | —            | ヘルスケア      |
| MORGAN STANLEY               | 23    | 43.5  | 185               | 21,544       | 金融         |
| WABCO HOLDINGS INC           | —     | 1.2   | 12                | 1,462        | 資本財・サービス   |
| DOW CHEMICAL CO/THE          | 16    | 33.5  | 193               | 22,449       | 素材         |
| MSCI INC                     | —     | 1.5   | 12                | 1,438        | 金融         |
| MIDDLEBY CORP                | —     | 2     | 26                | 3,038        | 資本財・サービス   |
| COTY INC-CL A                | —     | 11.17 | 21                | 2,441        | 生活必需品      |
| BROADCOM LTD                 | 4     | 11.84 | 209               | 24,297       | 情報技術       |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     | —     | 1     | 14                | 1,714        | ヘルスケア      |
| ENSCO PLC-CL A               | 4     | —     | —                 | —            | エネルギー      |
| DICK'S SPORTING GOODS INC    | —     | 2     | 10                | 1,248        | 一般消費財・サービス |
| ACUITY BRANDS INC            | 1     | 1     | 20                | 2,348        | 資本財・サービス   |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 1     | —     | —                 | —            | ヘルスケア      |
| ARAMARK                      | —     | 10    | 34                | 4,023        | 一般消費財・サービス |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | —     | 5     | 13                | 1,600        | 素材         |
| DTE ENERGY COMPANY           | 2     | 5     | 48                | 5,675        | 公益事業       |
| CENTENE CORP                 | 2     | 5     | 30                | 3,593        | ヘルスケア      |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 6     | 15.5  | 55                | 6,413        | 金融         |
| ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS | 4     | —     | —                 | —            | その他        |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | —     | 7.5   | 39                | 4,557        | 金融         |
| GARTNER INC                  | —     | 2.5   | 23                | 2,777        | 情報技術       |
| SPLUNK INC                   | 2     | 6.5   | 36                | 4,197        | 情報技術       |
| WHITEWAVE FOODS CO           | 3     | 7.5   | 41                | 4,811        | 生活必需品      |
| AGCO CORP                    | 1     | 1     | 6                 | 701          | 資本財・サービス   |
| DOMINION RESOURCES INC/VA    | 9     | 18.5  | 140               | 16,243       | 公益事業       |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 2     | 10.5  | 46                | 5,406        | 生活必需品      |
| SMITH (A.O.) CORP            | —     | 3     | 14                | 1,648        | 資本財・サービス   |
| DEERE & CO                   | 5     | 8     | 84                | 9,758        | 資本財・サービス   |
| QUANTA SERVICES INC          | 2     | —     | —                 | —            | 資本財・サービス   |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | —     | 5.5   | 43                | 5,088        | 情報技術       |
| TIME WARNER INC              | 12.66 | 25.16 | 235               | 27,293       | 一般消費財・サービス |
| VMWARE INC-CLASS A           | 2     | 2     | 16                | 1,868        | 情報技術       |
| BAXALTA INC                  | 8     | —     | —                 | —            | その他        |
| TEGNA INC                    | —     | 11.5  | 24                | 2,892        | 一般消費財・サービス |
| NASDAQ INC                   | —     | 5     | 33                | 3,929        | 金融         |
| TARGA RESOURCES CORP         | 1     | 6     | 35                | 4,077        | エネルギー      |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | —     | 2.5   | 30                | 3,557        | 金融         |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 5     | 11    | 80                | 9,280        | 公益事業       |
| MEDNAX INC                   | —     | 3     | 20                | 2,388        | ヘルスケア      |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP       | 1     | 5     | 38                | 4,451        | 一般消費財・サービス |
| TELEFLEX INC                 | —     | 2     | 32                | 3,825        | ヘルスケア      |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 2     | 2     | 19                | 2,246        | 資本財・サービス   |
| MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR | —     | 3     | 24                | 2,843        | 資本財・サービス   |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 12.5  | 25.5  | 169               | 19,640       | 生活必需品      |
| AMETEK INC                   | 4.75  | 9.75  | 48                | 5,611        | 資本財・サービス   |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 2     | 9     | 39                | 4,623        | 生活必需品      |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 6     | 11.5  | 99                | 11,587       | 素材         |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 6     | 13.5  | 217               | 25,199       | 生活必需品      |
| SCANA CORP                   | —     | 3     | 21                | 2,467        | 公益事業       |
| KEURIG GREEN MOUNTAIN INC    | 1     | —     | —                 | —            | その他        |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    | 1     | 1     | 14                | 1,663        | 金融         |
| WR GRACE & CO                | —     | 1.5   | 10                | 1,206        | 素材         |
| VALSPAR CORP/THE             | —     | 2     | 20                | 2,407        | 素材         |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 0.3   | 0.8   | 31                | 3,664        | 一般消費財・サービス |
| LEUCADIA NATIONAL CORP       | 4     | 14    | 32                | 3,769        | 金融         |
| UGI CORP                     | —     | 5     | 22                | 2,634        | 公益事業       |
| CUMMINS INC                  | 3     | 5     | 68                | 7,967        | 資本財・サービス   |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 8     | 19.5  | 73                | 8,524        | 情報技術       |
| SABRE CORP                   | —     | 5     | 12                | 1,443        | 情報技術       |
| CDW CORP/DE                  | —     | 3     | 15                | 1,780        | 情報技術       |
| SIGNATURE BANK               | —     | 1.5   | 22                | 2,609        | 金融         |
| COSTAR GROUP INC             | —     | 1.5   | 28                | 3,347        | 情報技術       |
| MERCADOLIBRE INC             | —     | 1.5   | 26                | 3,028        | 情報技術       |
| HANESBRANDS INC              | 6     | 17    | 37                | 4,380        | 一般消費財・サービス |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 7     | 5.83  | 33                | 3,850        | 一般消費財・サービス |
| DEXCOM INC                   | —     | 4     | 24                | 2,898        | ヘルスケア      |
| DIAMONDBACK ENERGY INC       | —     | 3     | 30                | 3,528        | エネルギー      |
| SEATTLE GENETICS INC         | —     | 4     | 23                | 2,727        | ヘルスケア      |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | —     | 3     | 28                | 3,297        | ヘルスケア      |
| TRANSDigm GROUP INC          | 1     | 2     | 51                | 5,921        | 資本財・サービス   |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 2     | 5     | 51                | 5,971        | 電気通信サービス   |
| NIELSEN HOLDINGS PLC         | 6     | 11.5  | 48                | 5,648        | 資本財・サービス   |
| KINDER MORGAN INC            | 26.96 | 58.96 | 127               | 14,795       | エネルギー      |
| HCA HOLDINGS INC             | 5     | 11    | 86                | 10,066       | ヘルスケア      |
| CABOT OIL & GAS CORP         | 8     | 18    | 39                | 4,610        | エネルギー      |
| T-MOBILE US INC              | 5     | 10.5  | 59                | 6,900        | 電気通信サービス   |
| COCA-COLA CO/THE             | 62    | 128.5 | 530               | 61,570       | 生活必需品      |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  | 5     | —     | —                 | —            | 生活必需品      |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 3     | 7.5   | 39                | 4,612        | 資本財・サービス   |
| EATON VANCE CORP             | —     | 6     | 25                | 2,987        | 金融         |
| FMC TECHNOLOGIES INC         | 2     | 11    | 39                | 4,577        | エネルギー      |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 7     | 15    | 60                | 7,011        | 金融         |
| CSX CORP                     | 12    | 31    | 114               | 13,297       | 資本財・サービス   |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 期首    |        | 期末    |         | 業種等        |
|------------------------------|-------|--------|-------|---------|------------|
|                              | 株数    | 株数     | 評価額   |         |            |
|                              |       |        | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
| FLUOR CORP                   | 百株    | 百株     | 千円    | 千円      | 資本財・サービス   |
| LABORATORY GRP OF AMER HLDGS | 3     | 3      | 15    | 1,823   | ヘルスケア      |
| EXPEDIA INC                  | 1     | 3.5    | 45    | 5,305   | 一般消費財・サービス |
| AUTOLIV INC                  | 1.5   | 4      | 46    | 5,440   | 一般消費財・サービス |
| AMAZON.COM INC               | 2     | 3.5    | 39    | 4,541   | 一般消費財・サービス |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A   | 6     | 12.7   | 1,012 | 117,361 | 一般消費財・サービス |
| FLOWSERVE CORP               | —     | 7      | 25    | 2,902   | エネルギー      |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 3     | 3      | 14    | 1,687   | 資本財・サービス   |
| EXXON MOBIL CORP             | 4     | 7.5    | 73    | 8,518   | ヘルスケア      |
| FLIR SYSTEMS INC             | 61.26 | 131.76 | 1,146 | 132,987 | エネルギー      |
| AES CORP                     | 1     | 1      | 3     | 413     | 情報技術       |
| L3 TECHNOLOGIES INC          | 17    | 17     | 19    | 2,272   | 公益事業       |
| EVEREST RE GROUP LTD         | 1     | 2.5    | 38    | 4,431   | 資本財・サービス   |
| EOG RESOURCES INC            | 1     | 1      | 21    | 2,515   | 金融         |
| EQT CORP                     | 7     | 19     | 195   | 22,697  | エネルギー      |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 3     | 6      | 37    | 4,395   | エネルギー      |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 3     | 7      | 49    | 5,682   | 情報技術       |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 4     | 9.5    | 45    | 5,303   | ヘルスケア      |
| FORD MOTOR CO                | 50    | 108.5  | 137   | 15,890  | 一般消費財・サービス |
| MACY'S INC                   | 6     | 12     | 36    | 4,238   | 一般消費財・サービス |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A   | 2     | 2      | 5     | 623     | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         | 5.16  | 5.16   | 17    | 2,021   | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY MEDIA CORP - A       | 2     | —      | —     | —       | その他        |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C   | 3     | 3      | 7     | 913     | 一般消費財・サービス |
| MOBILEYE NV                  | —     | 5      | 19    | 2,311   | 情報技術       |
| AERCAP HOLDINGS NV           | —     | 8.5    | 36    | 4,252   | 資本財・サービス   |
| FORTINET INC                 | —     | 3.5    | 10    | 1,270   | 情報技術       |
| MARKEL CORP                  | 0.25  | 0.5    | 45    | 5,223   | 金融         |
| NEXTERA ENERGY INC           | 6.5   | 14     | 165   | 19,213  | 公益事業       |
| FREEMONT-MCMORAN INC         | 13.5  | 38.5   | 56    | 6,553   | 素材         |
| US BANCORP                   | 26    | 54     | 275   | 31,979  | 金融         |
| UNITED RENTALS INC           | 2     | 2      | 21    | 2,462   | 資本財・サービス   |
| F5 NETWORKS INC              | 1     | 3      | 43    | 5,014   | 情報技術       |
| FASTENAL CO                  | 3     | 9.5    | 43    | 5,086   | 資本財・サービス   |
| FISERV INC                   | 4     | 6.5    | 70    | 8,147   | 情報技術       |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 135   | 281.5  | 885   | 102,694 | 資本財・サービス   |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 2     | 7.5    | 33    | 3,860   | 一般消費財・サービス |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO    | 3     | 11.5   | 36    | 4,245   | 一般消費財・サービス |
| GENERAL MOTORS CO            | 22    | 44     | 158   | 18,373  | 一般消費財・サービス |
| TRIPADVISOR INC              | 2     | 2      | 10    | 1,180   | 一般消費財・サービス |
| LINKEDIN CORP - A            | 2     | —      | —     | —       | 情報技術       |
| GENERAL DYNAMICS CORP        | 4     | 8.5    | 149   | 17,354  | 資本財・サービス   |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 6     | 11.5   | 279   | 32,390  | 金融         |
| GAMESTOP CORP-CLASS A        | 2     | —      | —     | —       | 一般消費財・サービス |
| ALPHABET INC-CL A            | 4.2   | 9.3    | 769   | 89,205  | 情報技術       |
| ALPHABET INC-CL C            | 4.61  | 9.71   | 783   | 90,826  | 情報技術       |
| GENERAL MILLS INC            | 10    | 19     | 115   | 13,342  | 生活必需品      |
| FIRSTENERGY CORP             | 5.67  | 13.17  | 40    | 4,735   | 公益事業       |
| GENUINE PARTS CO             | 3     | 5.5    | 52    | 6,125   | 一般消費財・サービス |
| IHS MARKIT LTD               | —     | 13.55  | 49    | 5,746   | 資本財・サービス   |
| FIFTH THIRD BANCORP          | 13    | 23.5   | 62    | 7,292   | 金融         |
| HARRIS CORP                  | 2     | 5      | 51    | 5,922   | 情報技術       |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC  | 3     | 3      | 14    | 1,637   | 資本財・サービス   |
| HALLIBURTON CO               | 14    | 25     | 140   | 16,254  | エネルギー      |
| HOME DEPOT INC               | 18.5  | 39.5   | 530   | 61,519  | 一般消費財・サービス |
| ASSURANT INC                 | —     | 2.5    | 23    | 2,728   | 金融         |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 12    | 36.5   | 48    | 5,637   | 金融         |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | —     | 2      | 38    | 4,416   | 資本財・サービス   |
| HERSHEY CO/THE               | 2     | 4.5    | 46    | 5,421   | 生活必需品      |
| HARLEY-DAVIDSON INC          | 4     | 4      | 23    | 2,697   | 一般消費財・サービス |
| HUMANA INC                   | 2     | 4.5    | 91    | 10,592  | ヘルスケア      |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS    | 2     | —      | —     | —       | その他        |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | —     | 10     | 98    | 11,376  | 情報技術       |
| HELMEIRICH & PAYNE           | 1     | 6      | 47    | 5,517   | エネルギー      |
| HENRY SCHEIN INC             | 2     | 2.5    | 39    | 4,558   | ヘルスケア      |
| HP INC                       | 26    | 58     | 85    | 9,873   | 情報技術       |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS    | 26    | 50     | 112   | 13,080  | 情報技術       |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | —     | 4      | 13    | 1,613   | 一般消費財・サービス |
| HOLLYFRONTIER CORP           | 2     | 2      | 6     | 717     | エネルギー      |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | —     | 2      | 7     | 817     | 一般消費財・サービス |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 2     | 5      | 42    | 4,941   | 金融         |
| HARMAN INTERNATIONAL         | —     | 1.5    | 16    | 1,923   | 一般消費財・サービス |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 8     | 18.5   | 159   | 18,464  | 生活必需品      |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 13.5  | 29     | 486   | 56,378  | 情報技術       |
| INTERNATIONAL PAPER CO       | 7     | 13.5   | 72    | 8,393   | 素材         |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 4     | 4      | 21    | 2,500   | 資本財・サービス   |
| ZOETIS INC                   | 8     | 16.5   | 89    | 10,322  | ヘルスケア      |
| INGERSOLL-RAND PLC           | 3.15  | 9.65   | 72    | 8,381   | 資本財・サービス   |
| CHENIERE ENERGY INC          | 5     | 5      | 21    | 2,541   | エネルギー      |
| LEGGISSE & PLATT INC         | 2     | 2      | 9     | 1,111   | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIE C   | 10.86 | 18.86  | 61    | 7,151   | 一般消費財・サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C | —     | 1.35   | 2     | 345     | 一般消費財・サービス |
| WASTE CONNECTIONS INC        | —     | 7      | 56    | 6,578   | 資本財・サービス   |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 9     | 9      | 25    | 2,962   | 情報技術       |
| JM SMUCKER CO/THE            | 1     | 4      | 51    | 5,937   | 生活必需品      |
| JOHNSON & JOHNSON            | 41.5  | 86     | 1,000 | 115,960 | ヘルスケア      |
| ABBVIE INC                   | 24.66 | 51.66  | 331   | 38,464  | ヘルスケア      |
| HOLOGIC INC                  | 3     | 11     | 44    | 5,108   | ヘルスケア      |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 5     | 10.5   | 120   | 13,958  | 生活必需品      |
| KROGER CO                    | 12    | 30     | 98    | 11,452  | 生活必需品      |
| KLA-TENCOR CORP              | 1.5   | 5      | 39    | 4,614   | 情報技術       |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 4     | 8.2    | 211   | 24,514  | 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  |            |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC    | 百株    | 百株     | 千円    | 千円      | 情報技術       |
| L BRANDS INC                 | 1     | 3.3    | 48    | 5,658   | 一般消費財・サービス |
| LOWE'S COS INC               | 3     | 8.5    | 52    | 6,042   | 一般消費財・サービス |
| ELI LILLY & CO               | 14    | 27.5   | 195   | 22,663  | 一般消費財・サービス |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC   | 14.5  | 31.5   | 240   | 27,859  | ヘルスケア      |
| LAM RESEARCH CORP            | 5     | 10     | 58    | 6,799   | 電気通信サービス   |
| RANGE RESOURCES CORP         | 3     | 6      | 65    | 7,574   | 情報技術       |
| JONES LANG LASALLE INC       | 3     | 3      | 9     | 1,139   | エネルギー      |
| LOEWS CORP                   | —     | 1      | 10    | 1,236   | 不動産        |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 5     | 12     | 55    | 6,441   | 金融         |
| MCDONALD'S CORP              | 4     | 9      | 59    | 6,942   | 金融         |
| 3M CO                        | 13.5  | 26     | 313   | 36,309  | 一般消費財・サービス |
| FACEBOOK INC-A               | 9.5   | 19     | 336   | 39,056  | 資本財・サービス   |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V   | 31.5  | 72.5   | 905   | 105,004 | 情報技術       |
| MANPOWERGROUP INC            | —     | 8.17   | 46    | 5,351   | 情報技術       |
| S&P GLOBAL INC               | 1     | 1      | 8     | 1,041   | 資本財・サービス   |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 5     | 9      | 101   | 11,822  | 金融         |
| CONCHO RESOURCES INC         | 1     | 2.3    | 50    | 5,850   | 素材         |
| ENVISION HEALTHCARE CORP     | 2     | 4      | 53    | 6,246   | エネルギー      |
| FIRST DATA CORP-CLASS A      | —     | 5.33   | 35    | 4,156   | ヘルスケア      |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC      | —     | 18.5   | 28    | 3,314   | 情報技術       |
| PHILLIPS 66                  | —     | 8      | 24    | 2,873   | 電気通信サービス   |
| CONDUENT INC                 | 7.5   | 15.5   | 130   | 15,101  | エネルギー      |
| HILTON GRAND VACATIONS-WI    | —     | 7.51   | 10    | 1,212   | 情報技術       |
| MURPHY OIL CORP              | —     | 1.75   | 4     | 537     | 一般消費財・サービス |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 3     | 3      | 9     | 1,063   | エネルギー      |
| MATTEL INC                   | 9     | 18     | 52    | 6,086   | 一般消費財・サービス |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 6     | 14     | 42    | 4,954   | 一般消費財・サービス |
| MYLAN NV                     | 2     | 4.5    | 40    | 4,703   | 生活必需品      |
| METLIFE INC                  | 7     | 12.5   | 48    | 5,645   | ヘルスケア      |
| MARVEL TECHNOLOGY GROUP LTD  | 14    | 28     | 150   | 17,435  | 金融         |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 5     | 22     | 31    | 3,665   | 情報技術       |
| MONSANTO CO                  | 1.85  | 4.35   | 36    | 4,187   | 情報技術       |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 7     | 15     | 163   | 18,950  | 素材         |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 0.5   | 1      | 42    | 4,944   | ヘルスケア      |
| MERCK & CO. INC.             | 2     | 4      | 55    | 6,415   | 資本財・サービス   |
| MASCO CORP                   | 8     | 8      | 25    | 2,985   | 資本財・サービス   |
| M & T BANK CORP              | 2.32  | 4.32   | 67    | 7,812   | 金融         |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 9     | 16.5   | 111   | 12,972  | 金融         |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A  | 2.85  | 10.95  | 90    | 10,443  | 一般消費財・サービス |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 2     | 5      | 37    | 4,334   | 情報技術       |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD    | 4     | 4      | 16    | 1,949   | 一般消費財・サービス |
| VANTIV INC - CL A            | —     | 4      | 24    | 2,873   | 情報技術       |
| NETAPP INC                   | 3     | 10     | 35    | 4,085   | 情報技術       |
| NIKE INC - CL B              | 19    | 43.5   | 232   | 26,926  | 一般消費財・サービス |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 5     | 10     | 109   | 12,660  | 資本財・サービス   |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 5     | 5      | 32    | 3,735   | 情報技術       |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | —     | 3      | 22    | 2,562   | 金融         |
| ALLY FINANCIAL INC           | 6     | 19     | 37    | 4,351   | 金融         |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 2.5   | 5.5    | 129   | 15,039  | 資本財・サービス   |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC        | 5     | 9      | 61    | 7,103   | 一般消費財・サービス |
| NEWMONT MINING CORP          | 9     | 15.5   | 54    | 6,355   | 素材         |
| MCKESSON CORP                | 3.5   | 7      | 102   | 11,919  | ヘルスケア      |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 6     | 6      | 24    | 2,828   | 情報技術       |
| XYLEM INC                    | —     | 7.5    | 37    | 4,293   | 資本財・サービス   |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 23    | 49.5   | 451   | 52,412  | 生活必需品      |
| NUCOR CORP                   | 4     | 9      | 53    | 6,224   | 素材         |
| WESTERN UNION CO             | 10    | 10     | 22    | 2,614   | 情報技術       |
| NEWELL BRANDS INC            | 4     | 11.08  | 52    | 6,031   | 一般消費財・サービス |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 10.5  | 23     | 162   | 18,979  | エネルギー      |
| LIBERTY MEDIA CORP - C       | 4     | —      | —     | —       | その他        |
| LIBERTY BROADBAND-C          | —     | 2      | 15    | 1,741   | 一般消費財・サービス |
| PAYCHEX INC                  | 7     | 8.5    | 51    | 6,014   | 情報技術       |
| PATTERSON COS INC            | 3     | 3      | 12    | 1,479   | ヘルスケア      |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 1.5   | 3.5    | 97    | 11,339  | 一般消費財・サービス |
| ALTRIA GROUP INC             | 30    | 63     | 428   | 49,640  | 生活必需品      |
| P G & E CORP                 | 6     | 16.5   | 99    | 11,537  | 公益事業       |
| PFIZER INC                   | 91.58 | 192.08 | 642   | 74,549  | ヘルスケア      |
| ALKERMES PLC                 | 2     | 6      | 35    | 4,168   | ヘルスケア      |
| XCEL ENERGY INC              | 7     | 19     | 76    | 8,879   | 公益事業       |
| STRYKER CORP                 | 5     | 11     | 130   | 15,181  | ヘルスケア      |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 2     | 4      | 56    | 6,529   | 資本財・サービス   |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 2     | 5.5    | 100   | 11,645  | エネルギー      |
| POLARIS INDUSTRIES INC       | 1     | 1      | 8     | 970     | 一般消費財・サービス |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 40    | 80.7   | 681   | 78,981  | 生活必需品      |
| XELON CORP                   | 12.04 | 28.04  | 98    | 11,468  | 公益事業       |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 3     | 8      | 115   | 13,430  | ヘルスケア      |
| CONOCOPHILLIPS               | 19    | 37.5   | 186   | 21,594  | エネルギー      |
| PEPSICO INC                  | 20.85 | 45.85  | 474   | 55,007  | 生活必需品      |
| PRENENTIAL FINANCIAL INC     | 7     | 13     | 136   | 15,789  | 金融         |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 4     | 5.5    | 39    | 4,550   | 公益事業       |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 9.5   | 20     | 230   | 26,670  | 情報技術       |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD    | 2     | 2      | 13    | 1,507   | 金融         |
| PENTAIR PLC                  | 1.75  | 5.75   | 32    | 3,771   | 資本財・サービス   |
| QUALCOMM INC                 | 24    | 46.5   | 305   | 35,399  | 情報技術       |
| PARTNERRE LTD                | 1     | —      | —     | —       | その他        |
| INVESCO LTD                  | 8     | 16     | 49    | 5,723   | 金融         |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 1     | 3      | 50    | 5,897   | 一般消費財・サービス |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 4     | 8.5    | 49    | 5,735   | 金融         |
| ENERGEN CORP                 | 1     | —      | —     | —       | エネルギー      |
| RAYTHEON COMPANY             | 4.5   | 10     | 148   | 17,184  | 資本財・サービス   |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A  | 1     | 1      | 7     | 866     | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                           | 期首    |        | 当        |        | 期末    |        | 業種等        |
|------------------------------|-------|--------|----------|--------|-------|--------|------------|
|                              | 株数    | 株数     | 評価価額     |        | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |            |
|                              |       |        | 千アメリカ・ドル | 千円     |       |        |            |
| RED HAT INC                  | 4     | 7      | 50       | 5,855  |       |        | 情報技術       |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 1     | 2.6    | 92       | 10,704 |       |        | ヘルスケア      |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 6     | 7      | 39       | 4,579  |       |        | 資本財・サービス   |
| PRICELINE GROUP INC/THE      | 0.7   | 1.6    | 244      | 28,380 |       |        | 一般消費財・サービス |
| ROSS STORES INC              | 5     | 13.5   | 88       | 10,245 |       |        | 一般消費財・サービス |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | -     | 2.5    | 21       | 2,544  |       |        | 素材         |
| RESMED INC                   | -     | 6      | 37       | 4,401  |       |        | ヘルスケア      |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 2     | 6      | 55       | 6,430  |       |        | ヘルスケア      |
| ROBERT HALF INTL INC         | 3     | 3      | 14       | 1,681  |       |        | 資本財・サービス   |
| REYNOLDS AMERICAN INC        | 11.48 | 25.98  | 144      | 16,783 |       |        | 生活必需品      |
| RITE AID CORP                | 15    | 45     | 38       | 4,409  |       |        | 生活必需品      |
| RALPH LAUREN CORP            | 1     | 1      | 8        | 1,011  |       |        | 一般消費財・サービス |
| ROCKWELL COLLINS INC         | 1     | 3      | 27       | 3,192  |       |        | 資本財・サービス   |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 17    | 35.5   | 51       | 5,915  |       |        | 金融         |
| CHEVRON CORP                 | 27    | 59.5   | 689      | 79,925 |       |        | エネルギー      |
| EDISON INTERNATIONAL         | 6     | 9      | 63       | 7,411  |       |        | 公益事業       |
| TESLA MOTORS INC             | 1     | 4.5    | 104      | 12,068 |       |        | 一般消費財・サービス |
| SYMANTEC CORP                | 10    | 20     | 49       | 5,795  |       |        | 情報技術       |
| ENDO INTERNATIONAL PLC       | 3     | 3      | 4        | 570    |       |        | ヘルスケア      |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 3.02  | 5.52   | 64       | 7,531  |       |        | 資本財・サービス   |
| SYNOPLYS INC                 | 4     | 4      | 24       | 2,786  |       |        | 情報技術       |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC/A | 1     | 6.53   | 193      | 22,433 |       |        | 一般消費財・サービス |
| CBRE GROUP INC - A           | 4     | 12     | 37       | 4,331  |       |        | 不動産        |
| TWITTER INC                  | 8     | 25     | 43       | 5,073  |       |        | 情報技術       |
| NAVIENT CORP                 | 12    | -      | -        | -      |       |        | 金融         |
| SANDISK CORP                 | 2     | -      | -        | -      |       |        | その他        |
| SOUTHERN CO/THE              | 12    | 29     | 140      | 16,319 |       |        | 公益事業       |
| SYS CO CORP                  | 10    | 15     | 83       | 9,684  |       |        | 生活必需品      |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 5     | 9      | 105      | 12,243 |       |        | 金融         |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO       | 7     | 7      | 6        | 791    |       |        | エネルギー      |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | -     | 4      | 20       | 2,374  |       |        | 金融         |
| STERICYCLE INC               | 2     | 2      | 15       | 1,828  |       |        | 資本財・サービス   |
| SCHLUMBERGER LTD             | 18.5  | 44.93  | 385      | 44,686 |       |        | エネルギー      |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 4     | 4      | 16       | 1,892  |       |        | 資本財・サービス   |
| AT&T INC                     | 87.2  | 194.7  | 794      | 92,115 |       |        | 電気通信サービス   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        | -     | 5      | 25       | 2,916  |       |        | 資本財・サービス   |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 1     | 2.8    | 78       | 9,051  |       |        | 素材         |
| SEMPRA ENERGY                | 3.5   | 8.5    | 86       | 9,992  |       |        | 公益事業       |
| TIFFANY & CO                 | 1.5   | 4.5    | 34       | 4,009  |       |        | 一般消費財・サービス |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 5     | 11     | 41       | 4,853  |       |        | 情報技術       |
| TEXAS INSTRUMENTS INC        | 16    | 33     | 245      | 28,447 |       |        | 情報技術       |
| SALESFORCE.COM INC           | 10    | 21     | 155      | 18,010 |       |        | 情報技術       |
| SIGNET JEWELERS LTD          | 1     | 1      | 8        | 998    |       |        | 一般消費財・サービス |
| WESTROCK CO                  | 3.12  | 7.12   | 37       | 4,309  |       |        | 素材         |
| TIME WARNER CABLE            | 4.57  | -      | -        | -      |       |        | その他        |
| TECHSON CONTROLS INTERNATION | 7     | 27.53  | 117      | 13,599 |       |        | 資本財・サービス   |
| TESORO CORP                  | 2     | 4.5    | 36       | 4,262  |       |        | エネルギー      |
| UNION PACIFIC CORP           | 12.5  | 26.5   | 271      | 31,473 |       |        | 資本財・サービス   |
| MARATHON OIL CORP            | 11    | 24     | 41       | 4,842  |       |        | エネルギー      |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 9     | 18.5   | 91       | 10,610 |       |        | エネルギー      |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP     | 13    | 26     | 289      | 33,616 |       |        | 資本財・サービス   |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 10    | 21.5   | 246      | 28,613 |       |        | 資本財・サービス   |
| UNUM GROUP                   | 6     | 6      | 26       | 3,088  |       |        | 金融         |
| SPRINT CORP                  | 4.14  | 41.14  | 35       | 4,150  |       |        | 電気通信サービス   |
| QUINTILES IMS HOLDINGS INC   | -     | 3.53   | 27       | 3,192  |       |        | ヘルスケア      |
| VOYA FINANCIAL INC           | 5     | 5      | 19       | 2,280  |       |        | 金融         |
| AMEREN CORPORATION           | 6     | 8      | 41       | 4,823  |       |        | 公益事業       |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 14.5  | 30     | 485      | 56,339 |       |        | ヘルスケア      |
| VERISIGN INC                 | 3     | 1.5    | 12       | 1,423  |       |        | 情報技術       |
| VALERO ENERGY CORP           | 7     | 15     | 99       | 11,544 |       |        | エネルギー      |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGR | 1     | 2.3    | 59       | 6,955  |       |        | 一般消費財・サービス |
| FNF GROUP                    | 4     | 11     | 37       | 4,361  |       |        | 金融         |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 2     | 2      | 22       | 2,586  |       |        | ヘルスケア      |
| ANTHEM INC                   | 3.5   | 8      | 114      | 13,246 |       |        | ヘルスケア      |
| WALT DISNEY CO/THE           | 23.5  | 48.5   | 525      | 60,942 |       |        | 一般消費財・サービス |
| WELLS FARGO & CO             | 71.37 | 149.87 | 812      | 94,263 |       |        | 金融         |
| FOOT LOCKER INC              | 3     | 3      | 21       | 2,465  |       |        | 一般消費財・サービス |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 6     | 12.5   | 87       | 10,114 |       |        | 資本財・サービス   |
| WILLIAMS COS INC             | 12    | 20     | 63       | 7,405  |       |        | エネルギー      |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 2     | 5      | 37       | 4,369  |       |        | 一般消費財・サービス |
| WHITING PETROLEUM CORP       | 4     | -      | -        | -      |       |        | エネルギー      |
| WHIRLPOOL CORP               | 1     | 2      | 36       | 4,211  |       |        | 一般消費財・サービス |
| WAL-MART STORES INC          | 24    | 48.5   | 333      | 38,642 |       |        | 生活必需品      |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 3     | 7.5    | 80       | 9,305  |       |        | ヘルスケア      |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PL | 17    | 17     | 9        | 1,159  |       |        | エネルギー      |
| WYNN RESORTS LTD             | 2     | 2      | 18       | 2,151  |       |        | 一般消費財・サービス |
| XEROX CORP                   | 10.09 | 37.59  | 26       | 3,038  |       |        | 情報技術       |
| WVABTEC CORP                 | 2     | 2      | 16       | 1,949  |       |        | 資本財・サービス   |
| TJX COMPANIES INC            | 9     | 20.5   | 156      | 18,090 |       |        | 一般消費財・サービス |
| WATERS CORP                  | 2     | 2.5    | 34       | 4,034  |       |        | ヘルスケア      |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS  | -     | 3.5    | 24       | 2,892  |       |        | 資本財・サービス   |
| ALLERGAN PLC                 | 5.89  | 12.59  | 277      | 32,133 |       |        | ヘルスケア      |
| WHOLE FOODS MARKET INC       | 7     | 7      | 21       | 2,497  |       |        | 生活必需品      |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 13    | 28.5   | 235      | 27,281 |       |        | 生活必需品      |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 2.13  | 4.13   | 52       | 6,034  |       |        | 金融         |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 4     | 9.95   | 71       | 8,291  |       |        | 情報技術       |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 5     | 8.5    | 49       | 5,714  |       |        | 公益事業       |
| WESTAR ENERGY INC            | -     | 4      | 21       | 2,520  |       |        | 公益事業       |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 9     | 15     | 65       | 7,569  |       |        | 公益事業       |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 28    | 59     | 482      | 55,930 |       |        | 情報技術       |
| PPL CORP                     | 11    | 18     | 61       | 7,142  |       |        | 公益事業       |
| PULTEGROUP INC               | -     | 7      | 12       | 1,504  |       |        | 一般消費財・サービス |

| 銘柄                           | 期首     |        | 当        |        | 期末    |        | 業種等        |
|------------------------------|--------|--------|----------|--------|-------|--------|------------|
|                              | 株数     | 株数     | 評価価額     |        | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |            |
|                              |        |        | 千アメリカ・ドル | 千円     |       |        |            |
| PPG INDUSTRIES INC           | 4      | 9      | 86       | 10,055 |       |        | 素材         |
| NORTHERN TRUST CORP          | 3      | 6.5    | 57       | 6,710  |       |        | 金融         |
| PRECISION CASTPARTS CORP     | 2      | -      | -        | -      |       |        | その他        |
| NVIDIA CORP                  | 7      | 16     | 171      | 19,904 |       |        | 情報技術       |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 7.53   | 15.03  | 177      | 20,600 |       |        | 金融         |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP Q/A | 6      | 18     | 34       | 4,055  |       |        | 一般消費財・サービス |
| TERADATA CORP                | 3      | -      | -        | -      |       |        | 情報技術       |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 4      | 7.5    | 46       | 5,448  |       |        | 生活必需品      |
| NETFLIX INC                  | 6      | 13     | 170      | 19,740 |       |        | 一般消費財・サービス |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 6      | 12     | 176      | 20,523 |       |        | ヘルスケア      |
| NRG ENERGY INC               | 8      | -      | -        | -      |       |        | 公益事業       |
| TORCHMARK CORP               | 3.5    | 3.5    | 25       | 2,999  |       |        | 金融         |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 2      | 5      | 46       | 5,335  |       |        | 金融         |
| TEXTRON INC                  | 5      | 10     | 49       | 5,744  |       |        | 資本財・サービス   |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A   | 18     | 37.5   | 110      | 12,815 |       |        | 一般消費財・サービス |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B | 9      | 9      | 25       | 3,002  |       |        | 一般消費財・サービス |
| NEWS CORP - CLASS A          | 8      | 8      | 9        | 1,113  |       |        | 一般消費財・サービス |
| OGE ENERGY CORP              | -      | 5      | 16       | 1,921  |       |        | 公益事業       |
| OMNICOM GROUP                | 4      | 7.5    | 64       | 7,426  |       |        | 一般消費財・サービス |
| ORACLE CORP                  | 49     | 99     | 386      | 44,806 |       |        | 情報技術       |
| MASTERCARD INC - A           | 15     | 30     | 322      | 37,414 |       |        | 情報技術       |
| ONEOK INC                    | 5      | 5      | 28       | 3,332  |       |        | エネルギー      |
| CENTURYLINK INC              | 8.47   | 16.97  | 42       | 4,964  |       |        | 電気通信サービス   |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 2      | 3.5    | 65       | 7,561  |       |        | 資本財・サービス   |
| YUM! BRANDS INC              | 6      | 9.5    | 61       | 7,116  |       |        | 一般消費財・サービス |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 1      | 2.5    | 59       | 6,887  |       |        | 情報技術       |
| MOLSON COORS BREWING CO-B    | 2      | 6.5    | 63       | 7,407  |       |        | 生活必需品      |
| NOBLE ENERGY INC             | 5      | 10.5   | 39       | 4,553  |       |        | エネルギー      |
| BANK OF AMERICA CORP         | 157.13 | 322.63 | 727      | 84,364 |       |        | 金融         |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 2      | 5      | 45       | 5,277  |       |        | ヘルスケア      |
| NORDSTROM INC                | 2      | 2      | 9        | 1,044  |       |        | 一般消費財・サービス |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 14     | 25     | 189      | 21,991 |       |        | 金融         |
| ANALOG DEVICES INC           | 4      | 8      | 57       | 6,673  |       |        | 情報技術       |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 3      | 10     | 46       | 5,397  |       |        | 金融         |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 19.2   | 32.2   | 213      | 24,785 |       |        | 金融         |
| ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC  | -      | 1      | 11       | 1,285  |       |        | 素材         |
| ANADARKO PETROLEUM CORP      | 7      | 18     | 125      | 14,606 |       |        | エネルギー      |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 2      | 7      | 52       | 6,140  |       |        | 情報技術       |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 2      | 5.5    | 46       | 5,392  |       |        | 一般消費財・サービス |
| NEWFIELD EXPLORATION CO      | -      | 5      | 21       | 2,453  |       |        | エネルギー      |
| MALLINCKRODT PLC             | -      | 2      | 10       | 1,241  |       |        | ヘルスケア      |
| AVERY DENNISON CORP          | 2      | 3      | 21       | 2,524  |       |        | 素材         |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   | 9      | 19.5   | 110      | 12,793 |       |        | 情報技術       |
| EMERSON ELECTRIC CO          | 8      | 21     | 117      | 13,683 |       |        | 資本財・サービス   |
| AOI PLC                      | 4      | 8.5    | 96       | 11,177 |       |        | 金融         |
| AMGEN INC                    | 11     | 24     | 381      | 44,205 |       |        | ヘルスケア      |
| CORE LABORATORIES N.V.       | -      | 1      | 12       | 1,439  |       |        | エネルギー      |
| COACH INC                    | 5      | 12     | 41       | 4,868  |       |        | 一般消費財・サービス |
| EATON CORP PLC               | 7.62   | 15.12  | 101      | 11,726 |       |        | 資本財・サービス   |
| CELGENE CORP                 | 12     | 24.5   | 294      | 34,151 |       |        | ヘルスケア      |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 3      | 6      | 90       | 10,455 |       |        | 生活必需品      |
| APPLIED MATERIALS INC        | 18     | 33.5   | 109      | 12,733 |       |        | 情報技術       |
| CIT GROUP INC                | 2      | 9      | 38       | 4,490  |       |        | 金融         |
| CIMAREX ENERGY CO            | 1      | 2.5    | 34       | 4,040  |       |        | エネルギー      |
| CME GROUP INC                | 5      | 10     | 116      | 13,489 |       |        | 金融         |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 5.89   | 14.89  | 56       | 6,573  |       |        | エネルギー      |
| ECOLAB INC                   | 4      | 8.5    | 101      | 11,713 |       |        | 素材         |
| EQUIFAX INC                  | 2      | 4.5    | 53       | 6,253  |       |        | 資本財・サービス   |
| GAP INC/THE                  | 3      | 3      | 7        | 829    |       |        | 一般消費財・サービス |
| GILEAD SCIENCES INC          | 22     | 41.5   | 314      | 36,496 |       |        | ヘルスケア      |
| ST JUDE MEDICAL INC          | 4      | -      | -        | -      |       |        | ヘルスケア      |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC  | 2.76   | 4.76   | 43       | 4,997  |       |        | 生活必需品      |
| HORMEL FOODS CORP            | 3      | 6      | 21       | 2,475  |       |        | 生活必需品      |
| STATE STREET CORP            | 7      | 13     | 105      | 12,266 |       |        | 金融         |
| STAPLES INC                  | 8      | 8      | 7        | 847    |       |        | 一般消費財・サービス |
| SUNTRUST BANKS INC           | 8      | 13.5   | 74       | 8,647  |       |        | 金融         |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 20     | 35.5   | 145      | 16,927 |       |        | 金融         |
| IHS INC-CLASS A              | 1      | -      | -        | -      |       |        | その他        |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 8      | 13     | 60       | 6,960  |       |        | ヘルスケア      |
| B/E AEROSPACE INC            | -      | 2.5    | 15       | 1,769  |       |        | 資本財・サービス   |
| CAMPBELL SOUP CO             | 4      | 8      | 47       | 5,542  |       |        | 生活必需品      |
| CROWN HOLDINGS INC           | 3      | 3      | 15       | 1,839  |       |        | 素材         |
| CHUBB CORP                   | 3.5    | -      | -        | -      |       |        | その他        |
| CARDINAL HEALTH INC          | 4      | 9.5    | 71       | 8,235  |       |        | ヘルスケア      |
| FEDEX CORP                   | 4      | 8.5    | 161      | 18,696 |       |        | 資本財・サービス   |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 8      | 15     | 131      | 15,209 |       |        | 金融         |
| FMC CORP                     | 3      | 3      | 17       | 2,015  |       |        | 素材         |
| FLEX LTD                     | 10     | 10     | 14       | 1,661  |       |        | 情報技術       |
| CERNER CORP                  | 5      | 9.5    | 45       | 5,286  |       |        | ヘルスケア      |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 2      | 2      | 23       | 2,680  |       |        | 素材         |
| CITRIX SYSTEMS INC           | 3      | 5.5    | 49       | 5,790  |       |        | 情報技術       |
| INTEL CORP                   | 68     | 148.5  | 543      | 63,042 |       |        | 情報技術       |
| CAMERON INTERNATIONAL CORP   | 2      | -      | -        | -      |       |        | その他        |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 7      | 17     | 39       | 4,634  |       |        | 一般消費財・サービス |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 6      | 10.5   | 50       | 5,852  |       |        | 金融         |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 4.5    | 10     | 122      | 14,179 |       |        | 資本財・サービス   |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 61     | 30     | 13       | 1,600  |       |        | 一般消費財・サービス |
| ILLUMINA INC                 | 2      | 5.5    | 77       | 9,027  |       |        | ヘルスケア      |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP       | 12     | -      | -        | -      |       |        | エネルギー      |
| SEALED AIR CORP              | 3      | 8.5    | 40       | 4,639  |       |        | 素材         |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 0.5    | 1.3    | 83       | 9,667  |       |        | ヘルスケア      |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | -      | 6      | 52       | 6,067  |       |        | 情報技術       |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 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    |            |
| SNAP-ON INC                  | 1.5               | 1.5               | 26      | 3,026     | 資本財・サービス   |
| CALPINE INC                  | -                 | 12                | 14      | 1,646     | 公益事業       |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 5                 | -                 | -       | -         | その他        |
| CARMAX INC                   | 3                 | 8                 | 52      | 6,047     | 一般消費財・サービス |
| COMERICA INC                 | 3                 | 7                 | 48      | 5,644     | 金融         |
| INGREDION INC                | -                 | 3                 | 37      | 4,348     | 生活必需品      |
| DUKE ENERGY CORP             | 10.38             | 22.38             | 171     | 19,889    | 公益事業       |
| TARGET CORP                  | 8                 | 17.5              | 125     | 14,495    | 一般消費財・サービス |
| DOVER CORP                   | 2                 | 5.5               | 42      | 4,893     | 資本財・サービス   |
| VWV GRAINGER INC             | 1                 | 2.5               | 57      | 6,677     | 資本財・サービス   |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 2                 | 2                 | 11      | 1,315     | 資本財・サービス   |
| JOHNSON CONTROLS INC         | 10                | -                 | -       | -         | その他        |
| CINTAS CORP                  | 1                 | 3.5               | 40      | 4,686     | 資本財・サービス   |
| CA INC                       | 6                 | 6                 | 19      | 2,313     | 情報技術       |
| CONAGRA BRANDS INC           | 5                 | 11                | 42      | 4,903     | 生活必需品      |
| COLOROX COMPANY              | 2                 | 4.5               | 54      | 6,329     | 生活必需品      |
| ENTERGY CORP                 | 2                 | 4.5               | 31      | 3,709     | 公益事業       |
| MICROSOFT CORP               | 110               | 232               | 1,453   | 168,518   | 情報技術       |
| INCYTE CORP                  | 3                 | 6                 | 71      | 8,246     | ヘルスケア      |
| CVS HEALTH CORP              | 16.5              | 33                | 269     | 31,263    | 生活必需品      |
| MEDTRONIC PLC                | 21.56             | 42.56             | 314     | 36,432    | ヘルスケア      |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 19                | 36                | 80      | 9,325     | 情報技術       |
| BLACKROCK INC                | 2                 | 3.8               | 144     | 16,763    | 金融         |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 9                 | 9                 | 22      | 2,596     | 公益事業       |
| HASBRO INC                   | 3                 | 3                 | 24      | 2,873     | 一般消費財・サービス |
| KELLOGG CO                   | 4                 | 7                 | 50      | 5,854     | 生活必需品      |
| KEYCORP                      | 11                | 40                | 73      | 8,469     | 金融         |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 2                 | 2                 | 16      | 1,891     | 資本財・サービス   |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 25                | 52                | 232     | 26,947    | 生活必需品      |
| KOHL'S CORP                  | 3                 | 7.5               | 30      | 3,562     | 一般消費財・サービス |
| COOPER COS INC/THE           | -                 | 1                 | 17      | 2,065     | ヘルスケア      |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP   | 8                 | 23                | 36      | 4,205     | 金融         |
| APACHE CORP                  | 6                 | 14                | 87      | 10,123    | エネルギー      |
| CHUBB LTD                    | 4                 | 14.1              | 184     | 21,338    | 金融         |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 1                 | 4.5               | 32      | 3,772     | 情報技術       |
| ALLSTATE CORP                | 5                 | 12.5              | 91      | 10,594    | 金融         |
| EBAY INC                     | 16.5              | 34                | 104     | 12,123    | 情報技術       |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 16.5              | 34                | 140     | 16,322    | 情報技術       |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 2                 | 6                 | 45      | 5,330     | 素材         |
| XILINX INC                   | 3                 | 8                 | 47      | 5,478     | 情報技術       |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO   | 10.35             | 21.35             | 152     | 17,716    | ヘルスケア      |
| DISH NETWORK CORP-A          | 3                 | 6.5               | 40      | 4,646     | 一般消費財・サービス |
| YAHOO! INC                   | 11                | 28.5              | 117     | 13,662    | 情報技術       |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 3                 | 5.5               | 43      | 4,989     | 生活必需品      |
| TOLL BROTHERS INC            | 4                 | 4                 | 12      | 1,443     | 一般消費財・サービス |
| TRIMBLE INC                  | -                 | 5                 | 15      | 1,753     | 情報技術       |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP       | 4                 | 9                 | 56      | 6,495     | 情報技術       |
| LENNAR CORP-A                | 3                 | 8.5               | 37      | 4,292     | 一般消費財・サービス |
| LEAR CORP                    | 2                 | 2                 | 27      | 3,153     | 一般消費財・サービス |
| E*TRADE FINANCIAL CORP       | 7                 | 7                 | 25      | 2,959     | 金融         |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC    | 6                 | -                 | -       | -         | 資本財・サービス   |
| PROGRESSIVE CORP             | 8                 | 15.5              | 55      | 6,420     | 金融         |
| PRAXAIR INC                  | 4                 | 8                 | 93      | 10,812    | 素材         |
| PACCAR INC                   | 6                 | 11                | 71      | 8,300     | 資本財・サービス   |
| PMV CORP                     | 1                 | 3.5               | 32      | 3,744     | 一般消費財・サービス |
| EMC CORP/MA                  | 26                | -                 | -       | -         | その他        |
| BIOGEN INC                   | 3.5               | 6.5               | 194     | 22,538    | ヘルスケア      |
| IDEXX LABORATORIES INC       | -                 | 2                 | 23      | 2,760     | ヘルスケア      |
| STARBUCKS CORP               | 21                | 46.5              | 270     | 31,382    | 一般消費財・サービス |
| PERRIGO CO PLC               | 2                 | 5                 | 42      | 4,953     | ヘルスケア      |
| EVERSOURCE ENERGY            | 5                 | 10                | 54      | 6,327     | 公益事業       |
| INTUIT INC                   | 4                 | 8                 | 93      | 10,808    | 情報技術       |
| BORGWARNER INC               | 3                 | 9                 | 36      | 4,260     | 一般消費財・サービス |
| BEST BUY CO INC              | 5                 | 11                | 47      | 5,528     | 一般消費財・サービス |
| BALL CORP                    | 2                 | 5.46              | 41      | 4,810     | 素材         |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 23                | 45.5              | 100     | 11,707    | ヘルスケア      |
| BED BATH & BEYOND INC        | 3                 | 3                 | 12      | 1,406     | 一般消費財・サービス |
| XL GROUP LTD                 | 4                 | 12                | 44      | 5,115     | 金融         |
| ELECTRONIC ARTS INC          | 4                 | 10.5              | 82      | 9,575     | 情報技術       |
| VULCAN MATERIALS CO          | 1.5               | 3.5               | 42      | 4,980     | 素材         |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 4                 | 6.5               | 53      | 6,245     | ヘルスケア      |
| VF CORP                      | 6                 | 11                | 58      | 6,751     | 一般消費財・サービス |
| CBS CORP-CLASS B NON VOTING  | 6                 | 14                | 88      | 10,305    | 一般消費財・サービス |
| VIACOM INC-CLASS B           | 6                 | 14                | 53      | 6,224     | 一般消費財・サービス |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 1                 | 2.5               | 50      | 5,906     | 一般消費財・サービス |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC    | 5                 | 5                 | 8       | 928       | 情報技術       |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC   | 1                 | 3                 | 26      | 3,115     | ヘルスケア      |
| CARNIVAL CORP                | 5                 | 10                | 53      | 6,225     | 一般消費財・サービス |
| COMCAST CORP-CLASS A         | 38                | 75                | 531     | 61,600    | 一般消費財・サービス |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | -                 | 10                | 60      | 6,957     | 資本財・サービス   |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | -                 | 20                | 13      | 1,590     | 不動産        |
| アメリカ・ドル<br>通貨計 銘柄数<比率>       | 4,674.57<br>532銘柄 | 9,721.77<br>594銘柄 | -63,131 | 7,320,709 | <59.5%>    |
| (カナダ)                        | 百株                | 百株                | 千カナダ・ドル | 千円        |            |
| IMPERIAL OIL LTD             | 7                 | 14                | 64      | 5,623     | エネルギー      |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | -                 | 0.5               | 30      | 2,671     | 情報技術       |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD       | -                 | 9.38              | 30      | 2,668     | エネルギー      |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 3.21              | 8.21              | 53      | 4,708     | 一般消費財・サービス |
| SILVER WHEATON CORP          | 9                 | 9                 | 24      | 2,113     | 素材         |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 3                 | 3                 | 28      | 2,506     | 金融         |
| BCE INC                      | 2                 | 3                 | 17      | 1,524     | 電気通信サービス   |
| FRANCO-NEVADA CORP           | 3                 | 7                 | 56      | 4,990     | 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  |            |
| SUNCOR ENERGY INC             | 21.12          | 61.12            | 265         | 23,316  | エネルギー      |
| METRO INC                     | 6              | 6                | 24          | 2,106   | 生活必需品      |
| NATIONAL BANK OF CANADA       | 4              | 10               | 55          | 4,824   | 金融         |
| BANK OF NOVA SCOTIA           | 18             | 43               | 328         | 28,798  | 金融         |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE   | 7              | 14               | 155         | 13,672  | 金融         |
| TORONTO-DOMINION BANK         | 30             | 63               | 422         | 37,048  | 金融         |
| GREAT-WEST LIFE CO INC        | 6              | 7                | 24          | 2,168   | 金融         |
| ROYAL BANK OF CANADA          | 23             | 51               | 471         | 41,390  | 金融         |
| TOURMALINE OIL CORP           | 3              | 13               | 42          | 3,691   | エネルギー      |
| VERMILION ENERGY INC          | 4              | 4                | 22          | 1,971   | エネルギー      |
| TRANSCANADA CORP              | 12             | 27               | 164         | 14,438  | エネルギー      |
| PEMBINA PIPELINE CORP         | 9              | 18               | 75          | 6,589   | エネルギー      |
| BOMBARDIER INC-B              | 47             | 47               | 11          | 977     | 資本財・サービス   |
| BARRICK GOLD CORP             | 26             | 47               | 105         | 9,243   | 素材         |
| CAE INC                       | 7              | 7                | 12          | 1,129   | 資本財・サービス   |
| THOMSON REUTERS CORP          | 3.2            | 14.2             | 83          | 7,344   | 金融         |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN   | 14             | 26               | 63          | 5,583   | 素材         |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B     | -              | 1                | 25          | 2,244   | 素材         |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP | -              | 19               | 23          | 2,070   | 金融         |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A  | -              | 11               | 29          | 2,611   | エネルギー      |
| HYDRO ONE LTD                 | -              | 15               | 35          | 3,102   | 公益事業       |
| LOBLAW COMPANIES LTD          | 4.89           | 9.89             | 69          | 6,081   | 生活必需品      |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A      | -              | 10               | 36          | 3,171   | 公益事業       |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B   | 8              | 15               | 77          | 6,763   | 電気通信サービス   |
| AGNICO EAGLE MINES LTD        | 2              | 6                | 34          | 3,068   | 素材         |
| KINROSS GOLD CORP             | 25.34          | 25.34            | 11          | 982     | 素材         |
| BANK OF MONTREAL              | 11             | 22               | 214         | 18,788  | 金融         |
| POWER CORP OF CANADA          | 5              | 16               | 48          | 4,238   | 金融         |
| METHANEX CORP                 | -              | 6                | 36          | 3,189   | 素材         |
| CAMECO CORP                   | 4              | 4                | 5           | 498     | エネルギー      |
| TELUS CORP                    | 3              | 3                | 13          | 1,156   | 電気通信サービス   |
| POWER FINANCIAL CORP          | 2              | 10               | 33          | 2,960   | 金融         |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B      | 6              | 17               | 46          | 4,097   | 素材         |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A    | 1              | 3                | 42          | 3,685   | 一般消費財・サービス |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD  | -              | 80               | 34          | 3,059   | 素材         |
| AGRUM INC                     | 3              | 6                | 81          | 7,131   | 素材         |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES    | 19             | 41               | 171         | 15,040  | エネルギー      |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD   | 0.5            | 0.5              | 31          | 2,787   | 金融         |
| MAGNA INTERNATIONAL INC       | 7              | 12               | 70          | 6,169   | 一般消費財・サービス |
| WESTON (GEORGE) LTD           | -              | 2                | 22          | 1,979   | 生活必需品      |
| BLACKBERRY LTD                | -              | 27               | 25          | 2,233   | 情報技術       |
| SUN LIFE FINANCIAL INC        | 12             | 19               | 97          | 8,576   | 金融         |
| ENBRIDGE INC                  | 14             | 30               | 172         | 15,131  | エネルギー      |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A  | 16             | 31               | 135         | 11,845  | 金融         |
| MANULIFE FINANCIAL CORP       | 32             | 63               | 152         | 13,401  | 金融         |
| GOLDCORP INC                  | 12             | 26               | 49          | 4,363   | 素材         |
| ENCANA CORP                   | 15             | 44               | 74          | 6,495   | エネルギー      |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD  | 3              | 4                | 76          | 6,753   | 資本財・サービス   |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC  | 4              | 4                | 21          | 1,896   | 金融         |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC         | 4              | 4                | 13          | 1,172   | 一般消費財・サービス |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO      | 12             | 25               | 227         | 19,954  | 資本財・サービス   |
| CGI GROUP INC - CLASS A       | 3              | 7                | 45          | 3,990   | 情報技術       |
| HUSKY ENERGY INC              | 6.12           | 6.12             | 9           | 866     | エネルギー      |
| ONEX CORPORATION              | 3              | 3                | 26          | 2,340   | 金融         |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B     | 7              | 22               | 61          | 5,359   | 一般消費財・サービス |
| FINNING INTERNATIONAL INC     | 7              | 7                | 18          | 1,582   | 資本財・サービス   |
| SNC-LAVALIN GROUP INC         | 3              | 3                | 17          | 1,515   | 資本財・サービス   |
| ELDORADO GOLD CORP            | 3              | 3                | 1           | 116     | 素材         |
| IGM FINANCIAL INC             | 3              | 3                | 12          | 1,056   | 金融         |
| OPEN TEXT CORP                | 4              | 3                | 24          | 2,166   | 情報技術       |
| CI FINANCIAL CORP             | 6              | 6                | 17          | 1,494   | 金融         |
| SAPUTO INC                    | 6              | 6                | 28          | 2,466   | 生活必需品      |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD    | 9              | 33               | 47          | 4,174   | 素材         |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B   | 8              | 13               | 79          | 6,957   | 生活必需品      |
| YAMANA GOLD INC               | 42             | 52               | 21          | 1,911   | 素材         |
| FORTIS INC                    | 5              | 13               | 53          | 4,675   | 公益事業       |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP    | 8              | 25               | 42          | 3,754   | エネルギー      |
| CENOVUS ENERGY INC            | 12             | 25               | 49          | 4,348   | エネルギー      |
| DOLLARAMA INC                 | -              | 2                | 19          | 1,730   | 一般消費財・サービス |
| ALTAGAS LTD                   | -              | 8                | 27          | 2,425   | エネルギー      |
| KEYERA CORP                   | -              | 7                | 28          | 2,497   | エネルギー      |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP  | -              | 7                | 21          | 1,850   | エネルギー      |
| INTER PIPELINE LTD            | 8              | 8                | 23          | 2,062   | エネルギー      |
| CANADIAN OIL SANDS LTD        | 16             | -                | -           | -       | その他        |
| ARC RESOURCES LTD             | 10             | 10               | 22          | 1,936   | エネルギー      |
| カナダ・ドル<br>通貨計 銘柄数<比率>         | 662.38<br>68銘柄 | 1,396.26<br>82銘柄 | 5,575       | 489,083 | <4.0%>     |
| (オーストラリア)                     | 百株             | 百株               | 千オーストラリア・ドル | 千円      |            |
| MEDIBANK PRIVATE LTD          | -              | 93               | 26          | 2,257   | 金融         |
| BHP BILLITON LIMITED          | 56             | 116              | 295         | 25,160  | 素材         |
| SOUTH32 LTD                   | 91             | 225              | 62          | 5,307   | 素材         |
| LENLEAS GROUP                 | 20             | 20               | 28          | 2,450   | 不動産        |
| ASCIANO LTD                   | 21.33          | -                | -           | -       | その他        |
| ALUMINA LTD                   | 121            | 121              | 21          | 1,844   | 素材         |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD        | 10             | 20               | 63          | 5,429   | エネルギー      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD    | 48             | 48               | 28          | 2,387   | 素材         |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK     | 8              | 8                | 10          | 895     | 金融         |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD   | 42             | 87               | 278         | 23,752  | 金融         |
| WESTPAC BANKING CORP          | 50.81          | 108.5            | 368         | 31,387  | 金融         |
| SANTOS LTD                    | 16             | 96               | 40          | 3,458   | エネルギー      |
| AUST AND NZ BANKING GROUP     | 47             | 97               | 308         | 26,243  | 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             |            |
| RIO TINTO LTD                  | 7                | 12               | 71           | 6,065              | 素材         |
| ORIGIN ENERGY LTD              | 20               | 68               | 46           | 3,926              | エネルギー      |
| AMCOR LIMITED                  | 25               | 51               | 77           | 6,575              | 素材         |
| AURIZON HOLDINGS LTD           | 22               | 85               | 44           | 3,800              | 資本財・サービス   |
| OIL SEARCH LTD                 | 32               | 32               | 23           | 2,030              | エネルギー      |
| SEEK LTD                       | -                | 26               | 39           | 3,376              | 資本財・サービス   |
| TREASURY WINE ESTATES LTD      | -                | 26               | 27           | 2,373              | 生活必需品      |
| NEWCREST MINING LTD            | 9                | 22               | 45           | 3,851              | 素材         |
| INCITEC PIVOT LTD              | 73               | 73               | 26           | 2,281              | 素材         |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 30               | 58               | 494          | 42,112             | 金融         |
| CALTEX AUSTRALIA LTD           | -                | 8                | 24           | 2,073              | エネルギー      |
| ORICA LTD                      | 2                | 20               | 36           | 3,079              | 素材         |
| QBE INSURANCE GROUP LTD        | 30               | 60               | 76           | 6,540              | 金融         |
| WOOLWORTHS LTD                 | 21               | 49               | 119          | 10,177             | 生活必需品      |
| COCA-COLA AMATIL LTD           | -                | 26               | 26           | 2,282              | 生活必需品      |
| TABCORP HOLDINGS LTD           | 24               | 24               | 11           | 1,005              | 一般消費財・サービス |
| TELSTRA CORP LTD               | 74               | 136              | 71           | 6,115              | 電気通信サービス   |
| AMP LTD                        | 40.13            | 93.13            | 49           | 4,219              | 金融         |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI    | 12               | 12               | 26           | 2,229              | 素材         |
| MACQUARIE GROUP LTD            | 4.81             | 12.31            | 109          | 9,309              | 金融         |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD         | -                | 20               | 31           | 2,702              | 一般消費財・サービス |
| BANK OF QUEENSLAND LTD         | -                | 30               | 37           | 3,167              | 金融         |
| CSL LTD                        | 7                | 15.5             | 161          | 13,727             | ヘルスケア      |
| WESFARMERS LTD                 | 20.75            | 35.75            | 150          | 12,829             | 生活必需品      |
| COCHLEAR LTD                   | -                | 2                | 25           | 2,196              | ヘルスケア      |
| SUNCORP GROUP LTD              | 19               | 39               | 53           | 4,589              | 金融         |
| BORAL LTD                      | 24               | 24               | 13           | 1,122              | 素材         |
| ASX LTD                        | 6                | 6                | 30           | 2,623              | 金融         |
| COMPUTERSHARE LTD              | 9                | 9                | 11           | 959                | 情報技術       |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP      | 57               | 57               | 35           | 2,999              | 金融         |
| SONIC HEALTHCARE LTD           | 5                | 8                | 17           | 1,506              | ヘルスケア      |
| TRANSURBAN GROUP               | 23.22            | 80.22            | 84           | 7,200              | 資本財・サービス   |
| ILUKA RESOURCES LTD            | 7                | -                | -            | -                  | 素材         |
| CHALLENGER LTD                 | -                | 25               | 28           | 2,463              | 金融         |
| SYDNEY AIRPORT                 | 46               | 38               | 23           | 1,964              | 資本財・サービス   |
| TATTS GROUP LTD                | -                | 80               | 35           | 3,058              | 一般消費財・サービス |
| AGL ENERGY LTD                 | 9                | 25               | 55           | 4,764              | 公益事業       |
| BRAMBLES LTD                   | 24               | 45               | 57           | 4,855              | 資本財・サービス   |
| APA GROUP                      | -                | 31               | 27           | 2,360              | 公益事業       |
| DUET GROUP                     | -                | 100              | 27           | 2,375              | 公益事業       |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD         | -                | 4                | 29           | 2,469              | ヘルスケア      |
| オーストラリア・ドル株数・金額<br>通貨計 銘柄数<比率> | 1,214.05<br>41銘柄 | 2,607.41<br>52銘柄 | 3,921<br>--- | 333,940<br>< 2.7%> |            |
| <b>(香港)</b>                    | 百株               | 百株               | 千香港ドル        | 千円                 |            |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD      | 30               | 60               | 420          | 6,279              | 公益事業       |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L   | 60               | 60               | 212          | 3,179              | 一般消費財・サービス |
| MTR CORP                       | 20               | 75               | 287          | 4,299              | 資本財・サービス   |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES        | 30               | 50               | 520          | 7,774              | 不動産        |
| SINO LAND CO                   | 28               | 120              | 144          | 2,167              | 不動産        |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD      | 40.52            | 100.52           | 904          | 13,524             | 資本財・サービス   |
| WHARF HOLDINGS LTD             | 40               | 40               | 224          | 3,354              | 不動産        |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A       | 10               | 10               | 77           | 1,154              | 不動産        |
| CLP HOLDINGS LTD               | 25               | 70               | 516          | 7,717              | 公益事業       |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS         | 40               | 40               | 42           | 630                | 資本財・サービス   |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT     | 33.55            | 36.9             | 155          | 2,319              | 不動産        |
| HONG KONG & CHINA GAS          | 158.65           | 324.51           | 455          | 6,811              | 公益事業       |
| HANG SENG BANK LTD             | 10               | 34               | 505          | 7,563              | 金融         |
| WHEELOCK & CO LTD              | 20               | 20               | 91           | 1,364              | 不動産        |
| NEW WORLD DEVELOPMENT          | 90               | 90               | 76           | 1,143              | 不動産        |
| WH GROUP LTD                   | -                | 225              | 137          | 2,061              | 生活必需品      |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR    | 17               | 38               | 705          | 10,543             | 金融         |
| LI & FUNG LTD                  | 60               | 60               | 21           | 313                | 一般消費財・サービス |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD       | 20               | 120              | 207          | 3,096              | 不動産        |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG       | 10               | 10               | 27           | 404                | 一般消費財・サービス |
| BANK OF EAST ASIA LTD          | 20               | 20               | 62           | 935                | 金融         |
| SJM HOLDINGS LTD               | 100              | 100              | 60           | 905                | 一般消費財・サービス |
| SWIRE PROPERTIES LTD           | -                | 80               | 178          | 2,673              | 不動産        |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING   | 40.52            | 105.52           | 526          | 7,863              | 不動産        |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE     | 20               | 20               | 123          | 1,840              | 公益事業       |
| AIA GROUP LTD                  | 206              | 380              | 1,723        | 25,763             | 金融         |
| SANDS CHINA LTD                | 42               | 102              | 352          | 5,268              | 一般消費財・サービス |
| SHANGRI-LA ASIA LTD            | 40               | 40               | 32           | 490                | 一般消費財・サービス |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD   | -                | 55               | 152          | 2,281              | 一般消費財・サービス |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD     | 70               | 155              | 444          | 6,638              | 金融         |
| WYNN MACAU LTD                 | 60               | 60               | 78           | 1,169              | 一般消費財・サービス |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS       | -                | 130              | 120          | 1,805              | 電気通信サービス   |
| 香港ドル株数・金額<br>通貨計 銘柄数<比率>       | 1,341.24<br>28銘柄 | 2,831.45<br>32銘柄 | 9,588<br>--- | 143,343<br>< 1.2%> |            |
| <b>(シンガポール)</b>                | 百株               | 百株               | 千シンガポール・ドル   | 千円                 |            |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD       | 21               | 53               | 110          | 8,961              | 金融         |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD         | 30               | 68               | 121          | 9,806              | 金融         |
| SINGAPORE AIRLINES LTD         | 20               | 20               | 19           | 1,588              | 資本財・サービス   |
| KEPPEL CORP LTD                | 28               | 28               | 16           | 1,370              | 資本財・サービス   |
| CITY DEVELOPMENTS LTD          | 10               | 10               | 8            | 688                | 不動産        |
| CAPITALAND LTD                 | 70               | 70               | 21           | 1,747              | 不動産        |
| SEBACORP MARINE LTD            | 20               | -                | -            | -                  | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD   | 30               | 120              | 43           | 3,509              | 一般消費財・サービス |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP   | 40               | 105              | 96           | 7,804              | 金融         |
| GENTING SINGAPORE PLC          | -                | 450              | 42           | 3,453              | 一般消費財・サービス |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS   | 120              | 277              | 103          | 8,392              | 電気通信サービス   |

| 銘柄  | 期首             |               | 期末           |                   | 業種等        |
|---|----------------|---------------|--------------|-------------------|------------|
|   | 株数             | 株数            | 評価額          |                   |            |
|   |                |               | 外貨建金額        | 邦貨換算金額            |            |
| NOBLE GROUP LTD                                     | 38.18          | -             | -            | -                 | 資本財・サービス   |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING                          | 40             | 40            | 13           | 1,066             | 資本財・サービス   |
| SEMBACORP INDUSTRIES LTD                            | 40             | 40            | 12           | 992               | 資本財・サービス   |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD                           | 90             | 90            | 3            | 312               | 生活必需品      |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD                              | 20             | 20            | 14           | 1,163             | 金融         |
| COMFORTDELGRO CORP LTD                              | -              | 100           | 25           | 2,043             | 資本財・サービス   |
| STARHUB LTD   | -              | 120           | 34           | 2,792             | 電気通信サービス   |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD                            | 50             | 50            | 18           | 1,470             | 生活必需品      |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L                        | 40             | 40            | 9            | 798               | 不動産        |
| シンガポール・ドル株数・金額<br>通貨計 銘柄数<比率>                       | 707.18<br>17銘柄 | 1,701<br>18銘柄 | 717<br>---   | 57,962<br>< 0.5%> |            |
| <b>(ニュージーランド)</b>                                   | 百株             | 百株            | 千ニュージーランド・ドル | 千円                |            |
| MERIDIAN ENERGY LTD                                 | -              | 150           | 39           | 3,234             | 公益事業       |
| SPARK NEW ZEALAND LTD                               | 112            | 56            | 20           | 1,665             | 電気通信サービス   |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD                           | -              | 31            | 20           | 1,634             | 資本財・サービス   |
| FLETCHER BUILDING LTD                               | 19             | 19            | 19           | 1,604             | 素材         |
| ニュージーランド・ドル株数・金額<br>通貨計 銘柄数<比率>                     | 131<br>2銘柄     | 256<br>4銘柄    | 100<br>---   | 8,138<br>< 0.1%>  |            |
| <b>(イギリス)</b>                                       | 百株             | 百株            | 千イギリス・ポンド    | 千円                |            |
| MERLIN ENTERTAINMENT                                | -              | 50            | 22           | 3,232             | 一般消費財・サービス |
| TUI AG-DI   | 6              | 26            | 30           | 4,309             | 一般消費財・サービス |
| BP PLC  | 255            | 569           | 292          | 41,147            | エネルギー      |
| UNILEVER PLC  | 18             | 44.2          | 147          | 20,818            | 生活必需品      |
| BARCLAYS PLC  | 246            | 537.5         | 125          | 17,716            | 金融         |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC                            | 25             | 45.5          | 30           | 4,235             | 資本財・サービス   |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC                           | 32             | 32            | 10           | 1,521             | 一般消費財・サービス |
| RANDGOLD RESOURCES LTD                              | 2              | 2             | 13           | 1,875             | 素材         |
| REXAM PLC   | 10.28          | -             | -            | -                 | その他        |
| PRUDENTIAL PLC                                      | 39             | 77.5          | 124          | 17,462            | 金融         |
| INMARSAT PLC  | 12             | 12            | 9            | 1,339             | 電気通信サービス   |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP                        | 51.7           | 151.7         | 34           | 4,858             | 金融         |
| JOHNSON MATTHEY PLC                                 | 3.3            | 3.3           | 10           | 1,481             | 素材         |
| BAE SYSTEMS PLC                                     | 49             | 85            | 50           | 7,152             | 資本財・サービス   |
| AVIVA PLC   | 59.54          | 140.54        | 68           | 9,628             | 金融         |
| GLAXOSMITHKLINE PLC                                 | 67             | 156.5         | 249          | 35,175            | ヘルスケア      |
| WORLDPAY GROUP PLC                                  | -              | 57            | 16           | 2,295             | 情報技術       |
| AUTO TRADER GROUP PLC                               | -              | 42            | 17           | 2,415             | 情報技術       |
| DCC PLC   | -              | 1.5           | 9            | 1,310             | 資本財・サービス   |
| ROYAL MAIL PLC                                      | -              | 32.5          | 14           | 2,079             | 資本財・サービス   |
| RELX PLC  | 21             | 37            | 53           | 7,581             | 資本財・サービス   |
| BG GROUP PLC  | 50             | -             | -            | -                 | その他        |
| DIAGEO PLC  | 36             | 79.5          | 172          | 24,289            | 生活必需品      |
| RIO TINTO PLC                                       | 17             | 37.5          | 117          | 16,545            | 素材         |
| STANDARD CHARTERED PLC                              | 47             | 104           | 72           | 10,209            | 金融         |
| TESCO PLC   | 142            | 237.5         | 47           | 6,721             | 生活必需品      |
| FRESNILLO PLC                                       | 8              | 8             | 10           | 1,543             | 素材         |
| SMITH & NEPHEW PLC                                  | 11             | 24            | 29           | 4,123             | ヘルスケア      |
| GLENCORE PLC  | 156            | 376.5         | 112          | 15,837            | 素材         |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC                             | -              | 15            | 19           | 2,725             | 金融         |
| SMITHS GROUP PLC                                    | 9              | 9             | 13           | 1,837             | 資本財・サービス   |
| BABCOCK INTL GROUP PLC                              | 6              | 6             | 5            | 782               | 資本財・サービス   |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP                         | -              | 47            | 17           | 2,435             | 金融         |
| DIXONS CARPHONE PLC                                 | -              | 47            | 16           | 2,254             | 一般消費財・サービス |
| PEARSON PLC   | 15             | 15            | 12           | 1,729             | 一般消費財・サービス |
| SAINSBURY (J) PLC                                   | -              | 68.5          | 17           | 2,458             | 生活必需品      |
| NEXT PLC  | 1.5            | 6             | 24           | 3,411             | 一般消費財・サービス |
| TAYLOR WIMPEY PLC                                   | 40             | 40            | 6            | 954               | 一般消費財・サービス |
| WHITBREAD PLC                                       | 4              | 4             | 15           | 2,177             | 一般消費財・サービス |
| IMI PLC   | 4.75           | 4.75          | 5            | 712               | 資本財・サービス   |
| BUNZL PLC   | 9              | 9             | 18           | 2,675             | 資本財・サービス   |
| GKN PLC   | 26             | 26            | 8            | 1,210             | 一般消費財・サービス |
| VODAFONE GROUP PLC                                  | 362.45         | 778.45        | 161          | 22,797            | 電気通信サービス   |
| CRODA INTERNATIONAL PLC                             | 2              | 1.93          | 6            | 890               | 素材         |
| KINGFISHER PLC                                      | 39             | 97            | 33           | 4,745             | 一般消費財・サービス |
| WPP PLC   | 16             | 40.5          | 75           | 10,637            | 一般消費財・サービス |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC                          | 14.4           | 14.4          | 12           | 1,821             | 公益事業       |
| SEVERN TRENT PLC                                    | 3              | 13            | 28           | 4,053             | 公益事業       |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC                         | 8              | 18.3          | 124          | 17,532            | 生活必需品      |
| ST JAMES'S PLACE PLC                                | 6              | 27            | 28           | 4,019             | 金融         |
| SCHRODERS PLC                                       | -              | 5.5           | 16           | 2,348             | 金融         |
| TATE & LYLE PLC                                     | -              | 20            | 14           | 1,973             | 生活必需品      |
| AMEC FOSTER WHEELER PLC                             | 13             | -             | -            | -                 | エネルギー      |
| SSE PLC   | 17             | 32            | 49           | 6,931             | 公益事業       |
| WEIR GROUP PLC/THE BARRATT DEVELOPMENTS PLC         | 2              | 13            | 25           | 3,604             | 資本財・サービス   |
| ASTRAZENECA PLC                                     | 13             | 13            | 6            | 907               | 一般消費財・サービス |
| WOLSELEY PLC  | 18             | 39            | 179          | 25,306            | ヘルスケア      |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC                           | 3.23           | 6.73          | 33           | 4,735             | 資本財・サービス   |
| 3I GROUP PLC  | 69             | 230.5         | 57           | 8,076             | 金融         |
| SKY PLC   | 28             | 28            | 20           | 2,860             | 金融         |
| ASHTED GROUP PLC                                    | 13             | 41            | 40           | 5,704             | 一般消費財・サービス |
| SAGE GROUP PLC/THE NATIONAL GRID PLC                | 12             | 12            | 18           | 2,675             | 資本財・サービス   |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC                            | 23.79          | 23.79         | 15           | 2,248             | 情報技術       |
| RSA INSURANCE GROUP PLC                             | 50             | 107.5         | 102          | 14,392            | 公益事業       |
| IMPERIAL BRANDS PLC                                 | 807.78         | 2,157.78      | 140          | 19,819            | 金融         |
| CENTRICA PLC  | 23.8           | 23.8          | 13           | 1,925             | 金融         |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE PROVIDENT FINANCIAL PLC | 13             | 29.5          | 106          | 15,024            | 生活必需品      |
| ARM HOLDINGS PLC                                    | 78             | 168           | 38           | 5,451             | 公益事業       |
|   | -              | 7             | 20           | 2,829             | 一般消費財・サービス |
|   | -              | 5.5           | 15           | 2,240             | 金融         |
|   | 20             | -             | -            | -                 | その他        |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                           | 期首       |          | 期末    |         | 業種等        |
|------------------------------|----------|----------|-------|---------|------------|
|                              | 株数       | 株数       | 評価額   |         |            |
|                              |          |          | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
|                              | 百株       | 百株       | 千円    | 千円      |            |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 26.55    | 57.55    | 269   | 37,889  | 生活必需品      |
| SABMILLER PLC                | 13       | -        | -     | -       | その他        |
| BHP BILLITON PLC             | 35       | 65       | 87    | 12,270  | 素材         |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 4        | 10.5     | 28    | 3,945   | 生活必需品      |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 280      | 620.5    | 415   | 58,451  | 金融         |
| SHIRE PLC                    | 8        | 26.22    | 128   | 18,047  | ヘルスケア      |
| OLD MUTUAL PLC               | 77.12    | 197.12   | 41    | 5,779   | 金融         |
| ANGLO AMERICAN PLC           | 20       | 54       | 62    | 8,779   | 素材         |
| MONDI PLC                    | 4        | 19       | 31    | 4,409   | 素材         |
| WM MORRISON SUPERMARKETS     | 57       | 57       | 13    | 1,905   | 生活必需品      |
| CARNIVAL PLC                 | 4        | 4        | 16    | 2,390   | 一般消費財・サービス |
| COMPASS GROUP PLC            | 25.58    | 53.08    | 77    | 10,883  | 一般消費財・サービス |
| PERSIMMON PLC                | 4        | 16       | 31    | 4,369   | 一般消費財・サービス |
| BT GROUP PLC                 | 122      | 276      | 106   | 15,001  | 電気通信サービス   |
| BURBERRY GROUP PLC           | 7        | 21       | 31    | 4,439   | 一般消費財・サービス |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 3.53     | 2.94     | 10    | 1,532   | 一般消費財・サービス |
| ACGREKO PLC                  | 3.23     | -        | -     | -       | 資本財・サービス   |
| CAPITA PLC                   | 11       | 11       | 5     | 775     | 資本財・サービス   |
| TRAVIS PERKINS PLC           | 3        | 3        | 4     | 622     | 資本財・サービス   |
| INTERTEK GROUP PLC           | 3        | 3        | 10    | 1,469   | 資本財・サービス   |
| ITV PLC                      | 54       | 151.5    | 31    | 4,427   | 一般消費財・サービス |
| PETROFAC LTD                 | 9        | 9        | 8     | 1,175   | エネルギー      |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 6        | 13.5     | 39    | 5,562   | 金融         |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS  | 59       | 133      | 299   | 42,237  | エネルギー      |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  | 34       | 120.27   | 281   | 39,701  | エネルギー      |
| MEGGITT PLC                  | -        | 35       | 15    | 2,208   | 資本財・サービス   |
| G4S PLC                      | 32       | 32       | 7     | 1,084   | 資本財・サービス   |
| COBHAM PLC                   | 34       | 34       | 5     | 788     | 資本財・サービス   |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 4        | 4        | 7     | 1,029   | 金融         |
| INVESTEC PLC                 | 9        | 9        | 4     | 687     | 金融         |
| ANTOFAGASTA PLC              | 7        | 7        | 4     | 694     | 金融         |
| STANDARD LIFE PLC            | 27.09    | 92.09    | 33    | 4,675   | 金融         |
| EXPERIAN PLC                 | 15       | 28       | 44    | 6,226   | 資本財・サービス   |
| イギリス・ポンド 株数、金額               | 4,135.62 | 9,386.44 | 5,618 | 791,288 |            |
| 通貨計 銘柄数<比率>                  | 90銘柄     | 98銘柄     |       | < 6.4%> |            |
| (イスラエル)                      | 百株       | 百株       | 千円    | 千円      |            |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 50       | 50       | 35    | 1,057   | 電気通信サービス   |
| ELBIT SYSTEMS LTD            | -        | 3        | 118   | 3,575   | 資本財・サービス   |
| TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD  | 15       | -        | -     | -       | ヘルスケア      |
| BANK HAPOLIM BM              | -        | 34       | 79    | 2,409   | 金融         |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 48       | 48       | 75    | 2,275   | 金融         |
| NICE LTD                     | 2        | 2        | 53    | 1,604   | 情報技術       |
| イスラエル・シユゲル 株数、金額             | 115      | 137      | 362   | 10,923  |            |
| 通貨計 銘柄数<比率>                  | 4銘柄      | 5銘柄      |       | < 0.1%> |            |
| (スイス)                        | 百株       | 百株       | 千円    | 千円      |            |
| DUFREY AG-REG                | -        | 1.5      | 19    | 2,225   | 一般消費財・サービス |
| UBS GROUP AG-REG             | 62       | 125.5    | 210   | 24,113  | 金融         |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | -        | 0.5      | 26    | 2,993   | 素材         |
| ADECCO GROUP AG-REG          | 2        | 3.5      | 24    | 2,776   | 資本財・サービス   |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 11.2     | 24.1     | 582   | 66,675  | ヘルスケア      |
| SIKA AG-BR                   | 0.05     | 0.1      | 48    | 5,504   | 素材         |
| ABB LTD-REG                  | 34       | 68       | 148   | 16,993  | 資本財・サービス   |
| ARYZTA AG                    | 2        | 2        | 8     | 1,025   | 生活必需品      |
| TRANSOCEAN LTD               | 7        | -        | -     | -       | エネルギー      |
| SWISS RE AG                  | 6        | 11.5     | 110   | 12,633  | 金融         |
| NESTLE SA-REG                | 51       | 106      | 791   | 90,560  | 生活必需品      |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | -        | 0.5      | 24    | 2,773   | 金融         |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 0.5      | 1.5      | 26    | 3,070   | 資本財・サービス   |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 27.31    | 72.31    | 115   | 13,157  | 金融         |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 5        | 5        | 23    | 2,699   | 金融         |
| SGS SA-REG                   | 0.07     | 0.17     | 35    | 4,110   | 資本財・サービス   |
| GALENICA AG-REG              | -        | 0.12     | 14    | 1,623   | ヘルスケア      |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 0.5      | 1        | 32    | 3,672   | 一般消費財・サービス |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 2.5      | 5.3      | 150   | 17,251  | 金融         |
| BALOISE HOLDING AG - REG     | 1        | 1        | 13    | 1,491   | 金融         |
| NOVARTIS AG-REG              | 36.5     | 75.3     | 564   | 64,590  | ヘルスケア      |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 9        | 16.5     | 112   | 12,870  | 一般消費財・サービス |
| SWISSCOM AG-REG              | 0.5      | 1.2      | 55    | 6,398   | 電気通信サービス   |
| GEBERIT AG-REG               | 0.5      | 1        | 40    | 4,685   | 資本財・サービス   |
| GIVAUDAN-REG                 | 0.2      | 0.35     | 65    | 7,465   | 素材         |
| ACTELION LTD-REG             | 2        | 4        | 91    | 10,416  | ヘルスケア      |
| SYNGENTA AG-REG              | 1.5      | 3.4      | 140   | 16,106  | 素材         |
| SONOVA HOLDING AG-REG        | 1        | 1        | 12    | 1,413   | ヘルスケア      |
| LONZA GROUP AG-REG           | 1        | 2.5      | 45    | 5,252   | ヘルスケア      |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG        | 7.2      | 16.7     | 89    | 10,247  | 素材         |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 0.5      | 1.5      | 44    | 5,096   | 金融         |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG   | 1        | 1        | 13    | 1,550   | 資本財・サービス   |
| SWISS PRIME SITE-REG         | 1        | 4.5      | 38    | 4,348   | 不動産        |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | -        | 0.03     | 16    | 1,892   | 生活必需品      |
| スイス・フラン 株数、金額                | 274.03   | 558.58   | 3,739 | 427,685 |            |
| 通貨計 銘柄数<比率>                  | 29銘柄     | 33銘柄     |       | < 3.5%> |            |
| (デンマーク)                      | 百株       | 百株       | 千円    | 千円      |            |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 32       | 67.5     | 1,728 | 28,557  | ヘルスケア      |
| DANSKE BANK A/S              | 14       | 24       | 521   | 8,615   | 金融         |
| JSS A/S                      | -        | 6        | 143   | 2,366   | 資本財・サービス   |
| AP MOELLER-MAERSK A/S-A      | 0.1      | 0.1      | 113   | 1,879   | 資本財・サービス   |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 3        | 6        | 283   | 4,676   | 資本財・サービス   |
| TDC A/S                      | 13       | 13       | 47    | 782     | 電気通信サービス   |
| CARLSBERG AS-B               | 2        | 5.5      | 338   | 5,587   | 生活必需品      |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES       | 5        | 5        | 126   | 2,090   | 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     | 千円     | 千円      |            |
| COLOPLAST-B                  | 2      | 6.5    | 315    | 5,219   | ヘルスケア      |
| DSV A/S                      | 6      | 6      | 192    | 3,171   | 資本財・サービス   |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B       | 0.1    | 0.26   | 311    | 5,145   | 資本財・サービス   |
| PANDORA A/S                  | 1.5    | 3      | 262    | 4,329   | 一般消費財・サービス |
| CHR HANSEN HOLDING A/S       | -      | 3.5    | 138    | 2,291   | 素材         |
| GENMAB A/S                   | -      | 1.5    | 193    | 3,196   | ヘルスケア      |
| DONG ENERGY A/S              | -      | 8      | 208    | 3,445   | 公益事業       |
| デンマーク・クローネ 株数、金額             | 78.7   | 155.86 | 4,924  | 81,357  |            |
| 通貨計 銘柄数<比率>                  | 11銘柄   | 15銘柄   |        | < 0.7%> |            |
| (ノルウェー)                      | 百株     | 百株     | 千円     | 千円      |            |
| NORSK HYDRO ASA              | 27     | 27     | 112    | 1,526   | 素材         |
| DNB ASA                      | 16     | 30     | 398    | 5,414   | 金融         |
| ORKLA ASA                    | 12     | 42     | 325    | 4,423   | 生活必需品      |
| TELENOR ASA                  | 13     | 29     | 391    | 5,320   | 電気通信サービス   |
| STATOIL ASA                  | 18     | 43.5   | 691    | 9,386   | エネルギー      |
| YARA INTERNATIONAL ASA       | 2      | 8.5    | 299    | 4,063   | 素材         |
| MARINE HARVEST               | -      | 8.5    | 123    | 1,679   | 生活必需品      |
| SCHIBSTED ASA-B SHS          | 5      | 5      | 94     | 1,279   | 一般消費財・サービス |
| ノルウェー・クローネ 株数、金額             | 93     | 193.5  | 2,436  | 33,094  |            |
| 通貨計 銘柄数<比率>                  | 7銘柄    | 8銘柄    |        | < 0.3%> |            |
| (スウェーデン)                     | 百株     | 百株     | 千円     | 千円      |            |
| ERICSSON LM-B SHS            | 47     | 81     | 433    | 5,565   | 情報技術       |
| VOLVO AB-B SHS               | 22     | 63     | 686    | 8,802   | 資本財・サービス   |
| MILLICOM INTL CELLULAR-SDR   | 2      | 2      | 83     | 1,076   | 電気通信サービス   |
| SKF AB-B SHARES              | 7      | 7      | 118    | 1,515   | 資本財・サービス   |
| ELECTROLUX AB-SER B          | 3      | 15     | 330    | 4,245   | 一般消費財・サービス |
| NORDEA BANK AB               | 55     | 102    | 1,015  | 13,034  | 金融         |
| SWEDISH MATCH AB             | 3      | 3      | 87     | 1,119   | 生活必需品      |
| TELE2 AB-B SHS               | 3      | 3      | 21     | 282     | 電気通信サービス   |
| GETINGE AB-B SHS             | 2      | 2      | 29     | 380     | ヘルスケア      |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 26     | 49     | 466    | 5,988   | 金融         |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 20     | 60     | 738    | 9,468   | 金融         |
| SWEDBANK AB - A SHARES       | 15     | 34     | 731    | 9,383   | 金融         |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 14     | 35     | 861    | 11,055  | 一般消費財・サービス |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B   | 11     | 18     | 457    | 5,865   | 生活必需品      |
| SKANSKA AB-B SHS             | 6      | 18     | 382    | 4,912   | 資本財・サービス   |
| SANDVIK AB                   | 20     | 45     | 513    | 6,581   | 資本財・サービス   |
| INVESTOR AB-B SHS            | 6      | 12     | 409    | 5,259   | 金融         |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         | 8      | 24     | 679    | 8,720   | 資本財・サービス   |
| SECURITAS AB-B SHS           | 5      | 5      | 72     | 929     | 資本財・サービス   |
| TELIA CO AB                  | 36     | 84     | 312    | 4,014   | 電気通信サービス   |
| ALFA LAVAL AB                | 4      | 4      | 61     | 786     | 資本財・サービス   |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         | 5      | 16     | 405    | 5,205   | 資本財・サービス   |
| ASSA ABLOY AB-B              | 18     | 41     | 681    | 8,742   | 資本財・サービス   |
| LUNDIN PETROLEUM AB          | 8      | 8      | 153    | 1,973   | エネルギー      |
| BOLIDEN AB                   | 8      | 8      | 191    | 2,458   | 素材         |
| HUSQVARNA AB-B SHS           | -      | 24     | 168    | 2,161   | 一般消費財・サービス |
| KINNEVIG AB - B              | 5      | 5      | 111    | 1,425   | 金融         |
| HEXAGON AB-B SHS             | 4      | 10     | 342    | 4,398   | 情報技術       |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | -      | 13     | 215    | 2,760   | 金融         |
| スウェーデン・クローネ 株数、金額            | 363    | 791    | 10,764 | 138,113 |            |
| 通貨計 銘柄数<比率>                  | 27銘柄   | 29銘柄   |        | < 1.1%> |            |
| (ユーロ (アイルランド))               | 百株     | 百株     | 千円     | 千円      |            |
| BANK OF IRELAND              | 270    | 1,570  | 39     | 4,799   | 金融         |
| KERRY GROUP PLC-A            | 3      | 5.5    | 38     | 4,679   | 生活必需品      |
| CRH PLC                      | 14     | 26.5   | 84     | 10,428  | 素材         |
| PADDY POWER BETFAIR PLC      | -      | 2      | 20     | 2,509   | 一般消費財・サービス |
| ユーロ・アイルランド 株数、金額             | 287    | 1,604  | 182    | 22,416  |            |
| 通貨計 銘柄数<比率>                  | 3銘柄    | 4銘柄    |        | < 0.2%> |            |
| (ユーロ (オランダ))                 | 百株     | 百株     | 千円     | 千円      |            |
| QIAGEN N.V.                  | 4      | 4      | 10     | 1,333   | ヘルスケア      |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 11     | 32.5   | 93     | 11,446  | 資本財・サービス   |
| NN GROUP NV                  | -      | 7      | 22     | 2,820   | 金融         |
| UNILEVER NV-CVA              | 24     | 47     | 183    | 22,537  | 生活必需品      |
| HEINEKEN NV                  | 3      | 8.6    | 61     | 7,524   | 生活必需品      |
| RELX NV                      | 18.45  | 32.45  | 51     | 6,310   | 資本財・サービス   |
| AEGON NV                     | 26     | 86     | 44     | 5,456   | 金融         |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 18.23  | 37.24  | 73     | 9,018   | 生活必需品      |
| AKZO NOBEL                   | 5      | 10     | 59     | 7,338   | 素材         |
| KONINKLIJKE DSM NV           | 3      | 6      | 35     | 4,318   | 素材         |
| WOLTERS KLUWER               | 9      | 9.5    | 33     | 4,061   | 資本財・サービス   |
| BOSKALIS WESTMINSTER         | 1      | 1      | 3      | 406     | 資本財・サービス   |
| ING GROEP NV                 | 56     | 115    | 157    | 19,351  | 金融         |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 56     | 56     | 15     | 1,956   | 電気通信サービス   |
| ASML HOLDING NV              | 5.5    | 12.4   | 131    | 16,191  | 情報技術       |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA        | -      | 13     | 28     | 3,509   | 金融         |
| REINSTEAD HOLDING NV         | 3      | 3      | 16     | 1,993   | 資本財・サービス   |
| HAINEKEN HOLDING NV          | 2      | 2      | 13     | 1,627   | 生活必需品      |
| GEMALTO                      | 2      | 2      | 11     | 1,356   | 情報技術       |
| ALTICE NV - A                | 3      | 13.5   | 25     | 3,117   | 一般消費財・サービス |
| ALTICE NV - B                | 1      | 1      | 1      | 231     | 一般消費財・サービス |
| AIRBUS SE                    | 9      | 17.5   | 114    | 14,026  | 資本財・サービス   |
| EXOR NV                      | -      | 4.5    | 19     | 2,371   | 金融         |
| CNH INDUSTRIAL NV            | 14     | 46.5   | 38     | 4,730   | 資本財・サービス   |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 10     | 42     | 42     | 5,177   | 一般消費財・サービス |
| FERRARI NV                   | 1      | 4.5    | 24     | 3,041   | 一般消費財・サービス |
| ユーロ (アイルランド) 株数、金額           | 285.18 | 614.19 | 1,313  | 161,257 |            |
| 通貨計 銘柄数<比率>                  | 23銘柄   | 26銘柄   |        | < 1.3%> |            |
| (ユーロ (ベルギー))                 | 百株     | 百株     | 千円     | 千円      |            |
| UCB SA                       | 3      | 3      | 19     | 2,418   | ヘルスケア      |

| 銘柄                               | 期首      |        | 期末     |         | 業種等        |  |
|----------------------------------|---------|--------|--------|---------|------------|--|
|                                  | 株数      | 株数     | 評価額    |         |            |  |
|                                  |         |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額  |            |  |
| KBC GROEP NV                     | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円      | 金融         |  |
| COLRUYT SA                       | 5       | 9.5    | 56     | 6,985   | 生活必需品      |  |
| DELHAIZE GROUP                   | —       | 3.5    | 16     | 2,002   | その他        |  |
| GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA       | 1.5     | —      | —      | —       | 金融         |  |
| SOLVAY SA                        | 1       | 4      | 31     | 3,887   | 金融         |  |
| UMICORE                          | 1       | 3      | 33     | 4,055   | 素材         |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV       | 2       | 2      | 10     | 1,337   | 素材         |  |
| AGEAS                            | 11.5    | 24.2   | 242    | 29,727  | 生活必需品      |  |
| PROXIMUS                         | 3       | 3      | 11     | 1,414   | 金融         |  |
|                                  | —       | 7      | 19     | 2,389   | 電気通信サービス   |  |
| 国小計                              | 株数、金額   | 28     | 59.2   | 441     | 54,219     |  |
|                                  | 銘柄数<比率> | 8銘柄    | 9銘柄    | < 0.4%> | < 0.4%>    |  |
| ユーロ (ルクセンブルグ)                    | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円      |            |  |
| ARCELORMITTAL                    | 12      | 56     | 40     | 4,966   | 素材         |  |
| EUROFINS SCIENTIFIC              | —       | 0.6    | 25     | 3,084   | ヘルスケア      |  |
| SES                              | 6       | 19     | 40     | 4,914   | 一般消費財・サービス |  |
| TENARIS SA                       | 6       | 22     | 37     | 4,570   | エネルギー      |  |
| 国小計                              | 株数、金額   | 24     | 97.6   | 142     | 17,535     |  |
|                                  | 銘柄数<比率> | 3銘柄    | 4銘柄    | < 0.1%> | < 0.1%>    |  |
| ユーロ (フランス)                       | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円      |            |  |
| TOTAL SA                         | 32      | 67.5   | 324    | 39,851  | エネルギー      |  |
| MICHELIN (CGDE)                  | 2       | 6.5    | 68     | 8,439   | 一般消費財・サービス |  |
| AIR LIQUIDE SA                   | 5.15    | 12.79  | 133    | 16,441  | 素材         |  |
| KERING                           | 1       | 3.2    | 69     | 8,500   | 一般消費財・サービス |  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE            | 8       | 19     | 126    | 15,499  | 資本財・サービス   |  |
| BOUYGUES SA                      | 5       | 5      | 16     | 2,082   | 資本財・サービス   |  |
| BNP PARIBAS                      | 16.5    | 34.5   | 211    | 25,919  | 金融         |  |
| PEUGEOT SA                       | 11      | 11     | 18     | 2,237   | 一般消費財・サービス |  |
| NATIXIS                          | 30      | 30     | 16     | 2,006   | 金融         |  |
| THALES SA                        | 1       | 3      | 27     | 3,315   | 資本財・サービス   |  |
| DANONE                           | 8       | 18.5   | 113    | 13,967  | 生活必需品      |  |
| CARREFOUR SA                     | 11      | 22     | 50     | 6,165   | 生活必需品      |  |
| SUEZ                             | 1.5     | 9.5    | 13     | 1,621   | 公益事業       |  |
| VIVENDI                          | 17.96   | 27.46  | 50     | 6,161   | 一般消費財・サービス |  |
| L'OREAL                          | 4       | 7.9    | 135    | 16,620  | 生活必需品      |  |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN        | 7       | 16.5   | 74     | 9,091   | 資本財・サービス   |  |
| LEGRAND SA                       | 4       | 8.5    | 45     | 5,612   | 資本財・サービス   |  |
| ALCATEL-LUCENT SA                | 40      | —      | —      | —       | その他        |  |
| CASINO GUICHARD PERRACHON        | 2       | 2      | 9      | 1,183   | 生活必需品      |  |
| PERNOD RICARD SA                 | 3.6     | 8.1    | 85     | 10,447  | 生活必需品      |  |
| SOCIETE BIC SA                   | —       | 1.5    | 19     | 2,365   | 資本財・サービス   |  |
| EURAZEO                          | —       | 5      | 28     | 3,456   | 金融         |  |
| REXEL SA                         | —       | 16     | 25     | 3,189   | 資本財・サービス   |  |
| SOCIETE GENERALE SA              | 11      | 23.5   | 108    | 13,331  | 金融         |  |
| LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUITTON | 4       | 9.3    | 168    | 20,661  | 一般消費財・サービス |  |
| ACCOR SA                         | 3       | 3      | 11     | 1,402   | 一般消費財・サービス |  |
| CAPEGEMINI                       | 3       | 6      | 48     | 5,950   | 情報技術       |  |
| VALEO SA                         | 1       | 6.5    | 35     | 4,358   | 一般消費財・サービス |  |
| PUBLICIS GROUPE                  | 2.5     | 5      | 33     | 4,113   | 一般消費財・サービス |  |
| BUREAU VERITAS SA                | 4       | 4      | 7      | 931     | 資本財・サービス   |  |
| EIFFAGE                          | —       | 4      | 27     | 3,322   | 資本財・サービス   |  |
| SODEXO                           | 2       | 2      | 21     | 2,679   | 一般消費財・サービス |  |
| INGENICO GROUP                   | —       | 2      | 15     | 1,899   | 情報技術       |  |
| ZODIAC AEROSPACE                 | —       | 8      | 18     | 2,249   | 資本財・サービス   |  |
| ESSILOR INTERNATIONAL            | 3       | 7      | 73     | 9,045   | ヘルスケア      |  |
| AXA SA                           | 28      | 57.5   | 141    | 17,377  | 金融         |  |
| CHRISTIAN DIOR SE                | 1       | 2.5    | 49     | 6,057   | 一般消費財・サービス |  |
| TECHNIP SA                       | 2       | 2      | 13     | 1,679   | エネルギー      |  |
| EDENRED                          | 8       | 8      | 15     | 1,916   | 資本財・サービス   |  |
| RENAULT SA                       | 3       | 6      | 51     | 6,314   | 一般消費財・サービス |  |
| HERMES INTERNATIONAL             | 0.32    | 0.82   | 32     | 3,940   | 一般消費財・サービス |  |
| ATOS SE                          | 2       | 2      | 20     | 2,524   | 情報技術       |  |
| DASSAULT SYSTEMES SA             | 2.5     | 6      | 44     | 5,404   | 情報技術       |  |
| ORANGE                           | 25      | 66.5   | 98     | 12,067  | 電気通信サービス   |  |
| ALSTOM                           | 3.1     | 3.1    | 8      | 1,005   | 資本財・サービス   |  |
| SANOFI                           | 17.5    | 36     | 279    | 34,264  | ヘルスケア      |  |
| VINCI SA                         | 6       | 17     | 112    | 13,775  | 資本財・サービス   |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT             | 10      | 25     | 39     | 4,812   | 公益事業       |  |
| CREDIT AGRICOLE SA               | 12      | 38.5   | 46     | 5,731   | 金融         |  |
| ENGIE                            | 22.89   | 56.39  | 67     | 8,342   | 公益事業       |  |
| SAFRAN SA                        | 4.5     | 11.5   | 77     | 9,546   | 資本財・サービス   |  |
| ILIAD SA                         | —       | 1      | 18     | 2,290   | 電気通信サービス   |  |
| ARKEMA                           | 2       | 2      | 18     | 2,265   | 素材         |  |
| ADP                              | 1       | 1      | 10     | 1,243   | 資本財・サービス   |  |
| SCOR SE                          | 6       | 6      | 19     | 2,376   | 金融         |  |
| GRUPE EUROTUNNEL SE - REGR       | 11      | 11     | 10     | 1,241   | 資本財・サービス   |  |
| 国小計                              | 株数、金額   | 412.02 | 775.56 | 3,406   | 418,303    |  |
|                                  | 銘柄数<比率> | 49銘柄   | 55銘柄   | < 3.4%> | < 3.4%>    |  |
| ユーロ (ドイツ)                        | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円      |            |  |
| BAYER AG-REG                     | 11.5    | 25     | 254    | 31,216  | ヘルスケア      |  |
| EVONIK INDUSTRIES AG             | —       | 6      | 16     | 2,027   | 素材         |  |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED      | 19      | 48.5   | 87     | 10,778  | 金融         |  |
| COMMERZBANK AG                   | 14.9    | 49.9   | 38     | 4,693   | 金融         |  |
| VOLKSWAGEN AG                    | 0.5     | 0.5    | 7      | 908     | 一般消費財・サービス |  |
| VOLKSWAGEN AG-PREF               | 2.5     | 6      | 87     | 10,744  | 一般消費財・サービス |  |
| MAN SE                           | 1       | 1      | 9      | 1,171   | 資本財・サービス   |  |
| SIEMENS AG-REG                   | 11      | 24     | 278    | 34,196  | 資本財・サービス   |  |
| E.ON SE                          | 29.5    | 55.5   | 36     | 4,526   | 公益事業       |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG      | 5.5     | 11     | 98     | 12,132  | 一般消費財・サービス |  |
| GEA GROUP AG                     | 2       | 5.5    | 20     | 2,546   | 資本財・サービス   |  |
| OSRAM LICHT AG                   | 1.45    | 1.45   | 7      | 887     | 資本財・サービス   |  |
| CONTINENTAL AG                   | 2       | 3.3    | 61     | 7,572   | 一般消費財・サービス |  |
| BASF SE                          | 13.5    | 28.4   | 248    | 30,566  | 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  |            |  |
| LINDE AG   | 百株      | 百株     | 千ユーロ     | 千円      | 素材         |  |
| K+S AG-REG   | 3       | 7      | 108      | 13,338  | 素材         |  |
| ALLIANZ SE-REG   | 3       | 3      | 6        | 827     | 金融         |  |
| THYSSENKRUPP AG  | 7       | 14.6   | 234      | 28,735  | 素材         |  |
| HENKEL AG & CO KGAA WORIZUG                              | 5       | 15.5   | 34       | 4,280   | 生活必需品      |  |
| RWE AG   | 3       | 7      | 79       | 9,815   | 公益事業       |  |
| BRENNTAG AG  | 4       | 16.5   | 19       | 2,390   | 資本財・サービス   |  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA                                   | 3       | 8      | 41       | 5,105   | ヘルスケア      |  |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE                             | 5       | 11     | 79       | 9,782   | 情報技術       |  |
| SAP SE   | —       | 4      | 15       | 1,890   | 情報技術       |  |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG                               | 13      | 28.5   | 240      | 29,512  | 金融         |  |
| HEIDELBERGCEMENT AG                                      | 2       | 4.5    | 79       | 9,801   | 素材         |  |
| COVESTRO AG  | 3       | 6      | 51       | 6,328   | 素材         |  |
| INNOGY SE  | —       | 4      | 24       | 3,048   | 素材         |  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HDLG-PRF                               | —       | 6      | 18       | 2,328   | 一般消費財・サービス |  |
| BEIERSDORF AG  | 3       | 8      | 44       | 5,417   | 生活必需品      |  |
| MERCK KGAA   | 2       | 5      | 40       | 4,958   | ヘルスケア      |  |
| ADIDAS AG  | 3       | 5.7    | 58       | 7,159   | 一般消費財・サービス |  |
| HENKEL AG & CO KGAA                                      | 4       | 6.2    | 89       | 10,999  | 生活必需品      |  |
| METRO AG   | 2       | 4      | 39       | 4,842   | 生活必需品      |  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG                                  | 5       | 5      | 15       | 1,918   | 電気通信サービス   |  |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 46      | 95     | 155      | 19,117  | ヘルスケア      |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG                                 | 4.5     | 7.5    | 56       | 6,916   | 一般消費財・サービス |  |
| HANNOVER RUECK SE  | 14      | 31.1   | 223      | 27,485  | 情報技術       |  |
| DEUTSCHE POST AG-REG                                     | 14      | 41     | 66       | 8,205   | 金融         |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG                                       | 1       | 1      | 10       | 1,257   | 資本財・サービス   |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER                                | 11      | 27     | 85       | 10,480  | 金融         |  |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE                                  | 4       | —      | —        | —       | 金融         |  |
| LANXESS AG   | —       | 7      | 54       | 6,699   | 一般消費財・サービス |  |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR                                    | 3       | 9      | 34       | 4,230   | 素材         |  |
| SYMRISE AG   | 2       | 2      | 12       | 1,595   | 不動産        |  |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG                             | 7       | 15.8   | 47       | 5,883   | 素材         |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF                             | —       | 4      | 23       | 2,829   | 一般消費財・サービス |  |
| HUGO BOSS AG -ORD  | 1       | —      | —        | —       | 一般消費財・サービス |  |
| VONOVIA SE   | —       | 2.5    | 18       | 2,256   | 一般消費財・サービス |  |
|  | —       | 3.5    | 19       | 2,435   | 一般消費財・サービス |  |
|  | 6       | 11.5   | 35       | 4,380   | 不動産        |  |
| 国小計  | 株数、金額   | 297.85 | 693.45   | 3,422   | 420,227    |  |
|  | 銘柄数<比率> | 42銘柄   | 48銘柄     | < 3.4%> | < 3.4%>    |  |
| ユーロ (ポルトガル)  | 百株      | 百株     | 千ユーロ     | 千円      |            |  |
| JERONIMO MARTINS   | 8       | 8      | 12       | 1,570   | 生活必需品      |  |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA                              | 57      | 57     | 15       | 1,955   | 公益事業       |  |
| GALP ENERGIA SGPS SA                                     | —       | 18     | 25       | 3,132   | エネルギー      |  |
| 国小計  | 株数、金額   | 65     | 83       | 54      | 6,658      |  |
|  | 銘柄数<比率> | 2銘柄    | 3銘柄      | < 0.1%> | < 0.1%>    |  |
| ユーロ (スペイン)   | 百株      | 百株     | 千ユーロ     | 千円      |            |  |
| TELEFONICA SA  | 74      | 148    | 135      | 16,674  | 電気通信サービス   |  |
| ENDESA SA  | —       | 9      | 18       | 2,213   | 公益事業       |  |
| BANCO POPULAR ESPANOL                                    | 32.41   | 32.41  | 3        | 397     | 金融         |  |
| BANCO POPULAR ESPANOL-RTS                                | 32.41   | —      | —        | —       | その他        |  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA                             | 93.9    | 197.89 | 129      | 15,882  | 金融         |  |
| IBERDROLA SA   | 77.35   | 156.06 | 94       | 11,548  | 公益事業       |  |
| BANCO DE SABADELL SA                                     | 54.14   | 145.87 | 20       | 2,466   | 金融         |  |
| BANKINTER SA   | —       | 27     | 20       | 2,486   | 金融         |  |
| REPSOL SA  | 13      | 28     | 37       | 4,665   | エネルギー      |  |
| GRIFOLS SA   | 4       | 4      | 7        | 956     | ヘルスケア      |  |
| BANCO SANTANDER SA                                       | 212     | 428.5  | 219      | 26,936  | 金融         |  |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA                              | 12      | 32.6   | 44       | 5,493   | 資本財・サービス   |  |
| AMADEUS IT GROUP SA                                      | 9       | 14     | 61       | 7,514   | 情報技術       |  |
| GAS NATURAL SDG SA                                       | 6       | 6      | 10       | 1,292   | 公益事業       |  |
| CAIXABANK S.A  | 63      | 143.87 | 47       | 5,816   | 金融         |  |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI                             | —       | 49     | 26       | 3,242   | 資本財・サービス   |  |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV                              | 3       | 3      | 9        | 1,106   | 資本財・サービス   |  |
| AENA SA  | —       | 2      | 26       | 3,253   | 資本財・サービス   |  |
| IBERDROLA SA-RTS   | —       | 156.06 | 2        | 256     | その他        |  |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL                               | 14.5    | 37.5   | 119      | 14,671  | 一般消費財・サービス |  |
| ENAGAS SA  | 8       | 8      | 19       | 2,358   | 公益事業       |  |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA                             | 2       | 23     | 39       | 4,878   | 公益事業       |  |
| FERROVIAL SA   | 9       | 26     | 47       | 5,773   | 資本財・サービス   |  |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL                              | —       | 32     | 15       | 1,862   | 生活必需品      |  |
| BANQUIA SA   | 50      | 50     | 5        | 626     | 金融         |  |
| 国小計  | 株数、金額   | 769.71 | 1,759.76 | 1,159   | 142,375    |  |
|  | 銘柄数<比率> | 19銘柄   | 24銘柄     | < 1.2%> | < 1.2%>    |  |
| ユーロ (イタリア)   | 百株      | 百株     | 千ユーロ     | 千円      |            |  |
| BANCO POPOLARE SC  | 5       | —      | —        | —       | その他        |  |
| PRYSMIAN SPA   | 4       | 4      | 9        | 1,176   | 資本財・サービス   |  |
| ASSICURAZIONI GENERALI                                   | 13.11   | 40.11  | 56       | 6,963   | 金融         |  |
| MEDIOBANCA SPA   | 11.6    | 11.6   | 9        | 1,113   | 金融         |  |
| UNICREDIT SPA  | 68.33   | 149.33 | 39       | 4,902   | 金融         |  |
| TELECOM ITALIA SPA                                       | 148     | 298    | 24       | 3,007   | 電気通信サービス   |  |
| TELECOM ITALIA-RSP                                       | 97      | 97     | 6        | 807     | 電気通信サービス   |  |
| INTESA SANPAOLO  | 192     | 399.5  | 98       | 12,144  | 金融         |  |
| ATLANTIA SPA   | 6.77    | 14.77  | 33       | 4,060   | 資本財・サービス   |  |
| POSTE ITALIANE SPA                                       | —       | 29     | 17       | 2,195   | 金融         |  |
| ENI SPA  | 39      | 72     | 110      | 13,605  | エネルギー      |  |
| LEONARDO SPA   | 5       | 5      | 6        | 823     | 資本財・サービス   |  |
| BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA                             | 50.19   | —      | —        | —       | その他        |  |
| ENEL SPA   | 108     | 248    | 102      | 12,642  | 公益事業       |  |
| SNAM SPA   | 41      | 89     | 34       | 4,220   | エネルギー      |  |
| LUXOTTICA GROUP SPA                                      | 3       | 8      | 37       | 4,642   | 一般消費財・サービス |  |
| UBI BANCA SPA  | 20      | —      | —        | —       | 金融         |  |
| TERNA SPA  | 37      | 37     | 15       | 1,963   | 公益事業       |  |
| 国小計  | 株数、金額   | 849    | 1,502.31 | 604     | 74,268     |  |
|  | 銘柄数<比率> | 17銘柄   | 15銘柄     | < 0.6%> | < 0.6%>    |  |

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

| 銘柄                          | 期首               |                      | 期末                   |                       | 業種等      |
|-----------------------------|------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|----------|
|                             | 株数               | 株数                   | 評価額                  | 評価額                   |          |
| ユーロ (フィンランド)                | 百株               | 百株                   | 千ユーロ                 | 千円                    |          |
| UPM-KYMMENE OYJ             | 8                | 20.5                 | 47                   | 5,846                 | 素材       |
| NOKIA OYJ                   | 57               | 161                  | 73                   | 9,045                 | 情報技術     |
| WARTSILA OYJ ABP            | 3                | 3                    | 12                   | 1,568                 | 資本財・サービス |
| STORA ENSO OYJ-R SHS        | —                | 20                   | 20                   | 2,465                 | 素材       |
| METSO OYJ                   | 3                | 3                    | 8                    | 1,009                 | 資本財・サービス |
| ELISA OYJ                   | 2.5              | 2.5                  | 7                    | 963                   | 電気通信サービス |
| SAMPO OYJ-A SHS             | 7                | 11                   | 48                   | 5,952                 | 金融       |
| FORTUM OYJ                  | 7                | 7                    | 10                   | 1,275                 | 公益事業     |
| KONE OYJ-B                  | 6                | 13                   | 55                   | 6,863                 | 資本財・サービス |
| NOKIAN RENKAAT OYJ          | —                | 7                    | 25                   | 3,149                 | 一般消費サービス |
| NESTE OYJ                   | 4                | 4                    | 13                   | 1,615                 | エネルギー    |
| ORION OYJ-CLASS B           | —                | 5                    | 21                   | 2,671                 | ヘルスケア    |
| 国小計                         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 257<br>12銘柄          | 345<br>3銘柄           | 42,425<br><0.3%>      |          |
| ユーロ (オーストリア)                | 百株               | 百株                   | 千ユーロ                 | 千円                    |          |
| OMV AG                      | 6                | 6                    | 20                   | 2,508                 | エネルギー    |
| ERSTE GROUP BANK AG         | 4                | 10.5                 | 30                   | 3,775                 | 金融       |
| VOESTALPINE AG              | 2                | 8                    | 29                   | 3,613                 | 素材       |
| 国小計                         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 12<br>3銘柄            | 24.5<br>3銘柄          | 80<br><0.1%>          |          |
| ユーロ (その他)                   | 百株               | 百株                   | 千ユーロ                 | 千円                    |          |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | —                | 5                    | 15                   | 1,858                 | 生活必需品    |
| STMICROELECTRONICS NV       | 12               | 12                   | 12                   | 1,547                 | 情報技術     |
| 国小計                         | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 12<br>1銘柄            | 17<br>2銘柄            | 27<br><0.0%>          |          |
| ユーロ通貨計                      | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 3,139.26<br>179銘柄    | 7,487.57<br>205銘柄    | 11,182<br><11.2%>     |          |
| ファンダ合計                      | 株数、金額<br>銘柄数<比率> | 16,929.03<br>1,035銘柄 | 37,223.84<br>1,175銘柄 | 11,208.630<br><91.1%> |          |

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

| 銘柄                           | 期首               |                | 期末             |                 | 業種等     |
|------------------------------|------------------|----------------|----------------|-----------------|---------|
|                              | 株数               | 株数             | 評価額            | 評価額             |         |
| (アメリカ)                       | 千口               | 千口             | 千アメリカ・ドル       | 千円              |         |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 0.222            | 0.372          | 65             | 7,644           |         |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 0.444            | 0.934          | 173            | 20,135          |         |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 0.3              | 0.55           | 71             | 8,306           |         |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES    | 0.8              | 1.7            | 43             | 5,036           |         |
| VORNADO REALTY TRUST         | 0.356            | 0.606          | 64             | 7,453           |         |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 0.6              | 1              | 64             | 7,475           |         |
| EQUINIX INC                  | 0.104            | 0.234          | 87             | 10,126          |         |
| AMERICAN TOWER CORP          | 0.6              | 1.3            | 136            | 15,831          |         |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 1.328            | 2.728          | 49             | 5,757           |         |
| KIMCO REALTY CORP            | 0.6              | 1.8            | 46             | 5,337           |         |
| PARK HOTELS & RESORTS INC    | —                | 0.35           | 10             | 1,190           |         |
| PLUM CREEK TIMBER CO         | 0.4              | —              | —              | —               |         |
| VENTAS INC                   | 0.5              | 1.25           | 79             | 9,197           |         |
| WEYERHAEUSER CO              | 0.864            | 2.504          | 77             | 8,992           |         |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 0.7              | 0.7            | 13             | 1,531           |         |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | —                | 1.4            | 34             | 3,993           |         |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 0.45             | 1.15           | 98             | 11,432          |         |
| IRON MOUNTAIN INC            | 0.218            | 0.918          | 30             | 3,540           |         |
| VEREIT INC                   | 1.2              | 4.35           | 38             | 4,418           |         |
| PROLOGIS INC                 | 0.665            | 1.465          | 78             | 9,122           |         |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | —                | 0.2            | 22             | 2,575           |         |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | —                | 0.3            | 25             | 2,922           |         |
| DUKE REALTY CORP             | —                | 0.8            | 21             | 2,493           |         |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 0.1              | 0.25           | 57             | 6,688           |         |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 0.2              | 0.25           | 35             | 4,136           |         |
| WELLTOWER INC                | 0.6              | 1.2            | 82             | 9,517           |         |
| HCP INC                      | 0.7              | 1.2            | 36             | 4,287           |         |
| LIBERTY PROPERTY TRUST       | 0.3              | 0.3            | 12             | 1,396           |         |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | —                | 0.45           | 43             | 5,082           |         |
| MACERICH CO/THE              | 0.3              | 0.3            | 21             | 2,484           |         |
| ANALNY CAPITAL MANAGEMENT IN | 1.5              | 3.7            | 37             | 4,384           |         |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | —                | 0.65           | 29             | 3,411           |         |
| REALTY INCOME CORP           | —                | 0.95           | 56             | 6,543           |         |
| PUBLIC STORAGE               | 0.25             | 0.45           | 102            | 11,834          |         |
| REGENCY CENTERS CORP         | 0.3              | 0.3            | 20             | 2,411           |         |
| SL GREEN REALTY CORP         | —                | 0.4            | 42             | 4,983           |         |
| UDR INC                      | —                | 1.2            | 43             | 5,016           |         |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 0.3              | 0.55           | 56             | 6,556           |         |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | —                | 0.5            | 39             | 4,537           |         |
| アメリカ・ドル<br>通貨計               | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 14,901<br>28銘柄 | 39,261<br>38銘柄 | 2,050<br><1.9%> | 237,789 |
| (オーストラリア)                    | 千口               | 千口             | 千オーストラリア・ドル    | 千円              |         |
| SCENTRE GROUP                | 12.629           | 22.429         | 105            | 8,958           |         |
| DEXUS PROPERTY GROUP         | —                | 2.5            | 23             | 2,024           |         |
| GPT GROUP                    | 6.82             | 6.82           | 34             | 2,932           |         |
| MIRVAC GROUP                 | 13.9             | 13.9           | 29             | 2,521           |         |
| STOCKLAND                    | 6.1              | 6.1            | 27             | 2,384           |         |
| WESTFIELD CORP               | 2.6              | 5.6            | 53             | 4,530           |         |
| GOODMAN GROUP                | 3.7              | 8.8            | 62             | 5,350           |         |
| VICINITY CENTRES             | 4.523            | 19.523         | 58             | 4,987           |         |
| オーストラリア・ドル<br>通貨計            | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 50,272<br>7銘柄  | 85,672<br>8銘柄  | 395<br><0.3%>   | 33,690  |

| 銘柄                           | 期首               |                | 期末              |               | 業種等               |
|------------------------------|------------------|----------------|-----------------|---------------|-------------------|
|                              | 株数               | 株数             | 評価額             | 評価額           |                   |
| (香港)                         | 千口               | 千口             | 千香港ドル           | 千円            |                   |
| LINK REIT                    | 3                | 9.5            | 499             | 7,470         |                   |
| 香港ドル<br>通貨計                  | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 3<br>1銘柄       | 9.5<br>1銘柄      | 499<br><0.0%> | 7,470             |
| (シンガポール)                     | 千口               | 千口             | 千シンガポール・ドル      | 千円            |                   |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | —                | 12             | 28              | 2,307         |                   |
| CAPITALAND MALL TRUST        | —                | 9              | 17              | 1,428         |                   |
| シンガポール・ドル<br>通貨計             | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 9<br>1銘柄       | 21<br>2銘柄       | 46<br><0.0%>  | 3,736             |
| (イギリス)                       | 千口               | 千口             | 千イギリス・ポンド       | 千円            |                   |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    | 0.9              | 3.05           | 31              | 4,441         |                   |
| SEGRO PLC                    | 1.52             | 1.52           | 7               | 1,005         |                   |
| HAMMERSON PLC                | 1.2              | 1.2            | 6               | 957           |                   |
| BRITISH LAND CO PLC          | 2.3              | 2.3            | 14              | 2,027         |                   |
| イギリス・ポンド<br>通貨計              | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 5.92<br>4銘柄    | 8.07<br>4銘柄     | 59<br><0.1%>  | 8,431             |
| ユーロ (フランス)                   | 千口               | 千口             | 千ユーロ            | 千円            |                   |
| UNIBAIL-RODAMCO SE           | 0.15             | 0.37           | 82              | 10,173        |                   |
| GECINA SA                    | —                | 0.14           | 17              | 2,207         |                   |
| KLEPIERRE                    | 0.2              | 0.6            | 21              | 2,700         |                   |
| ユーロ通貨計                       | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 0.35<br>2銘柄    | 1.11<br>3銘柄     | 122<br><0.1%> | 15,081            |
| 合計                           | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 83,443<br>43銘柄 | 164,613<br>56銘柄 | —             | 306,200<br><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                 |       | 期 末   |       |
|-----------------------------|---------------------|-------|-------|-------|
|                             | 買 建 額               | 売 建 額 | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外                           | 百万円                 | 百万円   | 百万円   | 百万円   |
| S&P500 (アメリカ)               | 459                 | —     | —     | —     |
| S&P500 E-MINI FUTURE (アメリカ) | 65                  | —     | —     | —     |
| FT 100 (イギリス)               | 70                  | —     | —     | —     |
| 国                           | EURO STOXX 50 (ドイツ) | 93    | —     | —     |

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

■投資信託財産の構成

2017年1月10日現在

| 項 目          | 当 期        |       | 期 末        |       |
|--------------|------------|-------|------------|-------|
|              | 評 価 額      | 比 率   | 評 価 額      | 比 率   |
| 株式           | 千円         | %     | 千円         | %     |
| 投資信託証券       | 11,208,630 | 88.5  | 11,208,630 | 88.5  |
| コール・ローン等、その他 | 306,200    | 2.4   | 306,200    | 2.4   |
| 投資信託財産総額     | 1,154,152  | 9.1   | 1,154,152  | 9.1   |
| 投資信託財産総額     | 12,668,982 | 100.0 | 12,668,982 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。  
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、1月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=115.96円、1カナダ・ドル=87.72円、1オーストラリア・ドル=85.16円、1香港ドル=14.95円、1シンガポール・ドル=80.79円、1ニュージーランド・ドル=81.36円、1イギリス・ポンド=140.83円、1イスラエル・シェケル=30.16円、1スイス・フラン=114.37円、1デンマーク・クローネ=16.52円、1ノルウェー・クローネ=13.58円、1スウェーデン・クローネ=12.83円、1ユーロ=122.78円です。  
(注3) 当期末における外貨建純資産 (11,988,881千円) の投資信託財産総額 (12,668,982千円) に対する比率は、94.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年1月10日現在

| 項 目            | 当 期             | 期 末             |
|----------------|-----------------|-----------------|
| (A) 資産         | 24,539,159,531円 | 24,539,159,531円 |
| コール・ローン等       | 772,646,523     | 772,646,523     |
| 株式(評価額)        | 11,208,630,134  | 11,208,630,134  |
| 投資信託証券(評価額)    | 306,200,468     | 306,200,468     |
| 未収入金           | 12,032,120,677  | 12,032,120,677  |
| 未収配当金          | 13,767,352      | 13,767,352      |
| 差入委託証拠金        | 205,794,377     | 205,794,377     |
| (B) 負債         | 12,237,297,155  | 12,237,297,155  |
| 未払金            | 12,237,297,155  | 12,237,297,155  |
| (C) 純資産総額(A-B) | 12,301,862,376  | 12,301,862,376  |
| 元本             | 7,765,887,299   | 7,765,887,299   |
| 次期繰越損益金        | 4,535,975,077   | 4,535,975,077   |
| (D) 受益権総口数     | 7,765,887,299口  | 7,765,887,299口  |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 15,841円         | 15,841円         |

\*期首における元本額は3,950,340,521円、当期中における追加設定元本額は4,607,939,602円、同解約元本額は792,392,824円です。  
\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 4,451,587,527円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 880,692,967円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 2,433,606,805円です。  
\*当期末の計算口数当りの純資産額は15,841円です。

■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。<br>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<br>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<br>(円ベース) |           | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額    |
|-----------------|-------------|-----------|-----------|----------------------|-----------|------------|------------|--------------------|--------------|
|                 | 税込み<br>分配金  | 期中<br>騰落率 | (ベンチマーク)  | 期中<br>騰落率            |           |            |            |                    |              |
| 1期末(2017年6月15日) | 円<br>12,232 | 円<br>0    | %<br>22.3 | (ベンチマーク)<br>12,081   | %<br>20.8 | %<br>96.0  | %<br>1.4   | %<br>2.6           | 百万円<br>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。

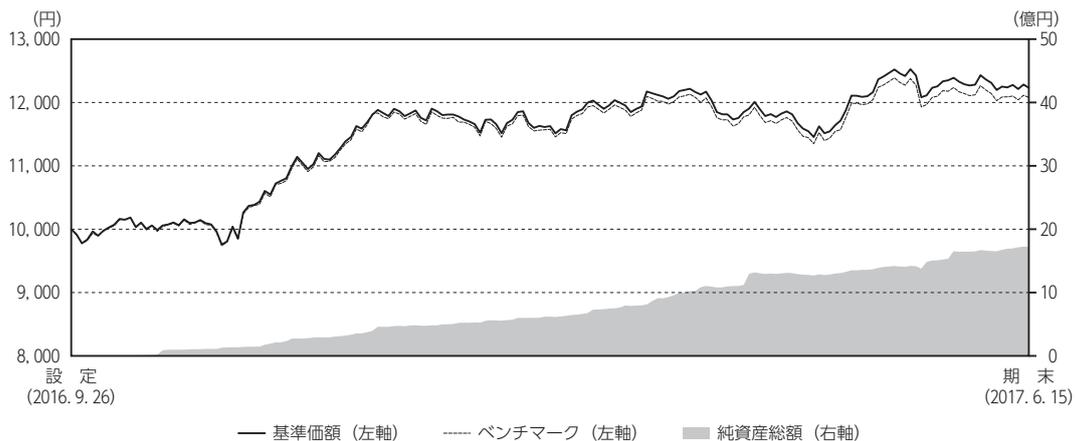
(注3) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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<br>(円ベース) |       | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 投資信託<br>証 券<br>組入比率 |
|------------------|---------|-------|---------------------------|-------|-------------|-------------|---------------------|
|                  | 騰 落 率   | 騰 落 率 | (ベンチマーク)                  | 騰 落 率 |             |             |                     |
| (設定) 2016年 9月26日 | 円       | %     | (9/23)                    | %     | %           | %           | %                   |
|                  | 10,000  | —     | 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。

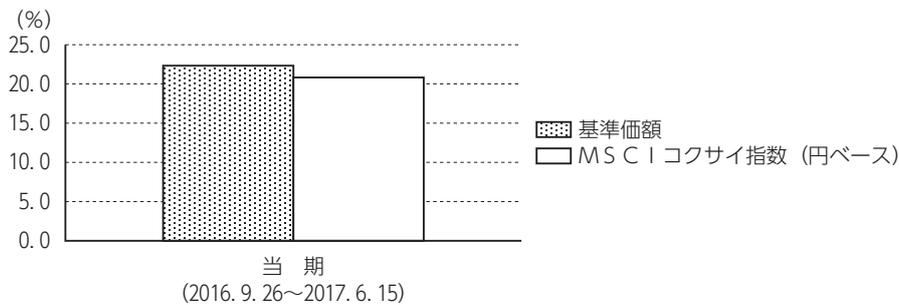
## ベンチマークとの差異について

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<br>～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<br>(2016.9.26~2017.6.15) |              | 項目の概要  |
|----------------|-----------------------------|--------------|--|
|                | 金額                          | 比率           |  |
| <b>信託報酬</b>    | 36円                         | 0.315%       | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>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                                     |
| <b>売買委託手数料</b> | 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<br>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)      |  |
| <b>有価証券取引税</b> | 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<br>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)      |  |
| <b>その他費用</b>   | 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   |
| <b>合計</b>      | <b>44</b>                   | <b>0.385</b> |  |

(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<br>千口 | 金額<br>千円  | 口数<br>千口 | 金額<br>千円 |
| 外国株式<br>インデックス<br>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<br>千口 | 評価額<br>千円 |
| 外国株式インデックス<br>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<br>マザーファンド | 1,719,734<br>千円 | 99.9<br>% |
| 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<br>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 WHOLESAL 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 VGT 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                               |            |
| ENERGY 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<br>銘柄数 < 比率 > | 70,414.74<br>601銘柄 | 488,092<br>53,553,464<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 9,569.26<br>91銘柄 | 38,648<br>3,203,593 | <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               |            |
| <b>(オーストラリア)</b>             |                     |                   |                  |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 17,626.31<br>61銘柄 | 27,341<br><2.6%> | 2,276,986  |
| <b>(香港)</b>                  |                     |                   |                  |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 22,449.58<br>39銘柄 | 77,592<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 10,987.2<br>21銘柄  | 421,139<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 1,439.89<br>6銘柄   | 58,005<br><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    |              | 357       | 資本財・サービス   |
| イギリス・ポンド通貨計                  | 70,938.77 |              | 43,542    | 6,092,048  |
|                              | 104銘柄     |              |           | <7.1%>     |
| (イスラエル)                      | 株数        | 千イスラエル・シェケル  | 千円        |            |
| 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・シェケル通貨計                | 1,372     | 3,039        | 94,688    |            |
|                              | 9銘柄       |              |           | <0.1%>     |
| (スイス)                        | 株数        | 千スイス・フラン     | 千円        |            |
| 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        | 千デンマーク・クローネ  | 千円        |            |
| 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        | 千ノルウェー・クローネ  | 千円        |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 1,371.83<br>10銘柄 | 16,457<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 5,296.8<br>30銘柄  | 966,654<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 6,869.5<br>4銘柄   | 1,261<br><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   |

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    |            |
| 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                  | 4,616.05     | 11,006 | 1,354,958 |            |
|                              | 株数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 27 銘柄        |        | <1.6% >   |            |
| <b>ユーロ (ベルギー)</b>            |                     | 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                  | 428.4        | 3,280  | 403,911   |            |
|                              | 株数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 10 銘柄        |        | <0.5% >   |            |
| <b>ユーロ (ルクセンブルグ)</b>         |                     | 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                  | 342.7        | 794    | 97,751    |            |
|                              | 株数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 5 銘柄         |        | <0.1% >   |            |
| <b>ユーロ (フランス)</b>            |                     | 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   |
| EIFFAGE                      |                     | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 6,069.82<br>66銘柄 | 27,176<br>3,345,648 | <3.9%>     |
|                              | 百株                  | 千ユーロ             | 千円                  |            |
| <b>ユーロ (ドイツ)</b>             |                     |                  |                     |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 5,467.67<br>56銘柄 | 27,278<br>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          |            |
|                              |    | 百株                  | 千ユーロ              | 千円              |            |
| <b>ユーロ (ポルトガル)</b>           |    |                     |                   |                 |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 671.5<br>3銘柄      | 420<br><0.1%>   | 51,769     |
| <b>ユーロ (スペイン)</b>            |    |                     |                   |                 |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 12,010.63<br>25銘柄 | 9,925<br><1.4%> | 1,221,903  |
| <b>ユーロ (イタリア)</b>            |    |                     |                   |                 |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 12,207.39<br>19銘柄 | 5,524<br><0.8%> | 680,136    |
| <b>ユーロ (フィンランド)</b>          |    |                     |                   |                 |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 2,051.5<br>12銘柄   | 2,922<br><0.4%> | 359,756    |
| <b>ユーロ (オーストリア)</b>          |    |                     |                   |                 |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 170.5<br>5銘柄      | 635<br><0.1%>   | 78,232     |

| 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 |            |
| 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      | 205          | 401    | 49,452     |
|                             | 銘柄数 < 比率 > | 2銘柄          |        | <0.1%>     |
| ユーロ通貨計                      | 株数、金額      | 51,110.66    | 90,626 | 11,157,058 |
|                             | 銘柄数 < 比率 > | 234銘柄        |        | <12.9%>    |
| ファンド合計                      | 株数、金額      | 267,640.91   | —      | 82,741,832 |
|                             | 銘柄数 < 比率 > | 1,261銘柄      |        | <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                           | 口数         | 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)                       | 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      | 276,728      | 15,397  | 1,689,467 |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 39銘柄         |         | <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      | 7.8          | 200     | 16,589    |
|                              | 銘柄数 < 比率 > | 3銘柄          |         | <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<br>銘柄数 < 比率 > | 501.701<br>8銘柄    | 2,468       | 205,598<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 52<br>1銘柄         | 3,307       | 46,532<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 219.6<br>4銘柄      | 450         | 35,925<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 104.35<br>5銘柄     | 633         | 88,681<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 10.15<br>5銘柄      | 1,005       | 123,793<br><0.1%>   |
| ファンド合計                       | □ 数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 1,172.329<br>65銘柄 | —           | 2,206,588<br><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<br>1,202 | 百万円<br>— |

(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。

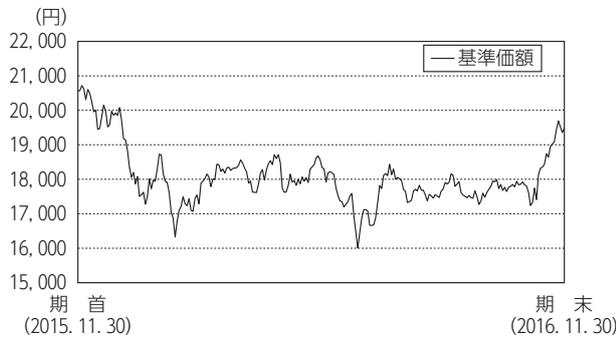
|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | 投資成果をMSCIコクサイ指数(円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。   |
| 主要投資対象 | 外国の株式(預託証券を含みます。)   |
| 運用方法   | ①主として外国の株式(預託証券を含みます。)に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数(円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。<br>②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。 |
| 株式組入制限 | 無制限   |

## 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 | △4.7  | 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<br>(株式) | 1円<br>( 1)  |
| (先物)            | ( 0)        |
| (投資信託証券)        | ( 0)        |
| 有価証券取引税<br>(株式) | 1<br>( 1)   |
| (投資信託証券)        | ( 0)        |
| その他費用<br>(保管費用) | 11<br>( 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<br>6,789.3<br>(△ 562.1)   | 千アメリカ・ドル<br>36,898<br>(△ 5,801)  | 百株<br>2,127.84 | 千アメリカ・ドル<br>8,628   |
|   | カナダ              | 百株<br>1,151.7<br>( 98.1)     | 千カナダ・ドル<br>3,778<br>(△ 96)       | 百株<br>279.5    | 千カナダ・ドル<br>262      |
|   | オーストラリア          | 百株<br>3,136<br>( 5.2)        | 千オーストラリア・ドル<br>2,839<br>(△ 190)  | 百株<br>265.5    | 千オーストラリア・ドル<br>165  |
|   | 香港               | 百株<br>3,343<br>( 182.29)     | 千香港ドル<br>5,446<br>( ー)           | 百株<br>70       | 千香港ドル<br>639        |
|   | シンガポール           | 百株<br>1,338<br>( ー)          | 千シンガポール・ドル<br>269<br>(△ 15)      | 百株<br>2,301.81 | 千シンガポール・ドル<br>73    |
|   | ニュージーランド         | 百株<br>313<br>( ー)            | 千ニュージーランド・ドル<br>112<br>( ー)      | 百株<br>ー        | 千ニュージーランド・ドル<br>ー   |
|   | イギリス             | 百株<br>8,747<br>(△ 17,827.63) | 千イギリス・ポンド<br>4,235<br>(△ 1,486)  | 百株<br>438.74   | 千イギリス・ポンド<br>306    |
|   | イスラエル            | 百株<br>27<br>( ー)             | 千イスラエル・シケル<br>550<br>( ー)        | 百株<br>206      | 千イスラエル・シケル<br>3,305 |
|   | スイス              | 百株<br>311.63<br>( ー)         | 千スイス・フラン<br>2,111<br>(△ 244)     | 百株<br>187.5    | 千スイス・フラン<br>504     |
|   | デンマーク            | 百株<br>136<br>( 27)           | 千デンマーク・クローネ<br>5,106<br>( ー)     | 百株<br>19       | 千デンマーク・クローネ<br>704  |
| 国 | ノルウェー            | 百株<br>222<br>( ー)            | 千ノルウェー・クローネ<br>3,291<br>(△ 47)   | 百株<br>ー        | 千ノルウェー・クローネ<br>ー    |
|   | スウェーデン           | 百株<br>392.5<br>( ー)          | 千スウェーデン・クローネ<br>4,855<br>(△ 120) | 百株<br>ー        | 千スウェーデン・クローネ<br>ー   |
|   | ユーロ<br>(アイルランド)  | 百株<br>42.5<br>( ー)           | 千ユーロ<br>350<br>( ー)              | 百株<br>ー        | 千ユーロ<br>ー           |
|   | ユーロ<br>(オランダ)    | 百株<br>454<br>( 15.3)         | 千ユーロ<br>886<br>(△ 122)           | 百株<br>27       | 千ユーロ<br>49          |
|   | ユーロ<br>(ベルギー)    | 百株<br>32<br>(△ 23)           | 千ユーロ<br>249<br>(△ 7)             | 百株<br>14       | 千ユーロ<br>107         |
|   | ユーロ<br>(ルクセンブルグ) | 百株<br>224<br>( ー)            | 千ユーロ<br>112<br>(△ 21)            | 百株<br>ー        | 千ユーロ<br>ー           |
|   | ユーロ<br>(フランス)    | 百株<br>562<br>( 35.51)        | 千ユーロ<br>2,171<br>(△ 69)          | 百株<br>661      | 千ユーロ<br>347         |
|   | ユーロ<br>(ドイツ)     | 百株<br>540.5<br>( 46.5)       | 千ユーロ<br>2,206<br>(△ 47)          | 百株<br>64.5     | 千ユーロ<br>232         |

|   | 買 付             |                            | 売 付                      |                |             |
|---|-----------------|----------------------------|--------------------------|----------------|-------------|
|   | 株 数             | 金 額                        | 株 数                      | 金 額            |             |
| 外 | ユーロ<br>(スペイン)   | 百株<br>1,638.5<br>( 869.43) | 千ユーロ<br>810<br>(△ 21)    | 百株<br>41       | 千ユーロ<br>57  |
|   | ユーロ<br>(イタリア)   | 百株<br>2,503<br>(△ 78.16)   | 千ユーロ<br>536<br>(△ 45)    | 百株<br>942.65   | 千ユーロ<br>183 |
|   | ユーロ<br>(フィンランド) | 百株<br>621.5<br>( ー)        | 千ユーロ<br>473<br>( ー)      | 百株<br>5        | 千ユーロ<br>19  |
|   | ユーロ<br>(オーストリア) | 百株<br>11<br>( ー)           | 千ユーロ<br>28<br>(△ 2)      | 百株<br>ー        | 千ユーロ<br>ー   |
| 国 | ユーロ<br>(その他)    | 百株<br>21<br>( 47)          | 千ユーロ<br>30<br>( 156)     | 百株<br>ー        | 千ユーロ<br>ー   |
|   | ユーロ<br>(ユーロ通貨計) | 百株<br>6,650<br>( 912.58)   | 千ユーロ<br>7,856<br>(△ 181) | 百株<br>1,755.15 | 千ユーロ<br>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<br>34.48<br>( 4.36) | 千アメリカ・ドル<br>1,885<br>( ー)  | 千口<br>2.14<br>( ー) | 千アメリカ・ドル<br>26<br>( ー)   |
|   | カナダ           | 千口<br>7.8<br>( ー)      | 千カナダ・ドル<br>188<br>( ー)     | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千カナダ・ドル<br>ー<br>( ー)     |
|   | オーストラリア       | 千口<br>17<br>( ー)       | 千オーストラリア・ドル<br>105<br>( ー) | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千オーストラリア・ドル<br>ー<br>( ー) |
|   | 香港            | 千口<br>2.5<br>( ー)      | 千香港ドル<br>131<br>( ー)       | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千香港ドル<br>ー<br>( ー)       |
|   | シンガポール        | 千口<br>53<br>( ー)       | 千シンガポール・ドル<br>86<br>(△ 0)  | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千シンガポール・ドル<br>ー<br>( ー)  |
| 国 | イギリス          | 千口<br>5.5<br>( ー)      | 千イギリス・ポンド<br>34<br>( ー)    | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千イギリス・ポンド<br>ー<br>( ー)   |
|   | ユーロ<br>(フランス) | 千口<br>1.46<br>( ー)     | 千ユーロ<br>115<br>(△ 0)       | 千口<br>ー<br>( ー)    | 千ユーロ<br>ー<br>( 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 SOLUTIO | —      | 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   |
| VWV GRAINGER INC             | 13     | 13      | 294      | 33,080    | 資本財・サービス   |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 26     | 29      | 178      | 20,121    | 資本財・サービス   |
| JOHNSON CONTROLS INC         | 142    | —       | —        | —         | その他        |
| CINTAS CORP                  | 21     | 21      | 242      | 27,286    | 資本財・サービス   |
| CA INC                       | 71.05  | 71.05   | 230      | 25,943    | 情報技術       |
| CONAGRA BRANDS INC           | 90     | 95      | 358      | 40,284    | 生活必需品      |
| CLOROX COMPANY               | 28     | 29.5    | 347      | 39,030    | 生活必需品      |
| ENTERGY CORP                 | 38     | 42.5    | 303      | 34,113    | 公益事業       |
| MICROSOFT CORP               | 1,614  | 1,693.5 | 10,345   | 1,163,051 | 情報技術       |
| INCYTE CORP                  | 34     | 38.5    | 404      | 45,476    | ヘルスケア      |
| CVS HEALTH CORP              | 239.74 | 247.24  | 1,876    | 210,906   | 生活必需品      |
| MEDTRONIC PLC                | 301.88 | 316.38  | 2,322    | 261,136   | ヘルスケア      |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 230    | 241     | 468      | 52,615    | 情報技術       |
| BLACKROCK INC                | 26     | 28.5    | 1,050    | 118,082   | 金融         |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 91     | 91      | 219      | 24,644    | 公益事業       |
| HASBRO INC                   | 24     | 26      | 225      | 25,318    | 一般消費財・サービス |
| KELLOGG CO                   | 56     | 61      | 449      | 50,485    | 生活必需品      |
| KEYCORP                      | 184    | 245     | 416      | 46,850    | 金融         |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 24     | 24      | 211      | 23,729    | 資本財・サービス   |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 347.11 | 356.11  | 1,526    | 171,585   | 生活必需品      |
| KOHL'S CORP                  | 44     | 44      | 238      | 26,780    | 一般消費財・サービス |
| COOPER COS INC/THE           | 10     | 11      | 187      | 21,041    | ヘルスケア      |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP   | 100    | 111     | 176      | 19,878    | 金融         |
| APACHE CORP                  | 81.1   | 87.6    | 532      | 59,816    | エネルギー      |
| CHUBB LTD                    | 70     | 107.99  | 1,384    | 155,686   | 金融         |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 20     | 20      | 136      | 15,379    | 情報技術       |
| ALLSTATE CORP                | 89     | 87      | 605      | 68,101    | 金融         |
| EBAY INC                     | 237    | 250     | 712      | 80,127    | 情報技術       |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 234    | 249.5   | 995      | 111,886   | 情報技術       |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 32     | 35      | 257      | 28,994    | 素材         |
| XILINX INC                   | 56     | 59.5    | 321      | 36,127    | 情報技術       |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO   | 155.1  | 143.1   | 1,099    | 123,647   | ヘルスケア      |
| DISH NETWORK CORP-A          | 47     | 53      | 305      | 34,373    | 一般消費財・サービス |
| YAHOO! INC                   | 193    | 210     | 873      | 98,210    | 情報技術       |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 8,560.7<br>84銘柄 | 9,531<br>90銘柄 | 37,543<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 15,529.36<br>54銘柄 | 18,405.06<br>63銘柄 | 25,803  | 2,171,113<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 18,012.77<br>35銘柄 | 21,468.06<br>38銘柄 | 68,937  | 999,599<br><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<br>—             | 百株<br>160         | 千シンガポール・ドル<br>45 | 千円<br>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<br>銘柄数 < 比率 > | 12,483.01<br>21銘柄 | 11,519.2<br>20銘柄 | 4,708<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 1,091.89<br>4銘柄   | 1,404.89<br>6銘柄  | 718<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 99,273.49<br>107銘柄 | 89,754.12<br>106銘柄 | 39,793<br><7.1% > | 5,589,335  |  |
| (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<br>銘柄数 < 比率 > | 1,551<br>6銘柄       | 1,372<br>6銘柄       | 2,392<br><0.1% >  | 70,144     |  |
| (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<br>銘柄数 < 比率 > | 3,679.5<br>35銘柄 | 3,803.63<br>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<br>銘柄数 < 比率 > | 1,006.3<br>12銘柄 | 1,150.3<br>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<br>銘柄数 < 比率 > | 1,177.83<br>7銘柄 | 1,399.83<br>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<br>銘柄数 < 比率 > | 29銘柄     | 30銘柄     | <1.1% > |            |         |
| <b>ユーロ (アイルランド)</b>          |                     |          |          |         |            |         |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 3銘柄      | 4銘柄      | 1,184   | 141,808    | <0.2% > |
| <b>ユーロ (オランダ)</b>            |                     |          |          |         |            |         |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 4,125.57 | 4,567.87 | 9,054   | 1,083,881  | <1.4% > |
| <b>ユーロ (ベルギー)</b>            |                     |          |          |         |            |         |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 440.9    | 435.9    | 3,117   | 373,141    | <0.5% > |
| <b>ユーロ (ルクセンブルグ)</b>         |                     |          |          |         |            |         |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 398      | 622      | 685     | 82,053     | <0.1% > |
| <b>ユーロ (フランス)</b>            |                     |          |          |         |            |         |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 6,035.9<br>63銘柄 | 5,972.41<br>65銘柄 | 23,347  | 2,794,752<br><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 & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 48.5                | 50.5             | 373               | 44,731  | ヘルスケア               |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG                                 | 210.5               | 225              | 1,429             | 171,129 | 一般消費財・サービス          |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG                                 | 247.5               | 270              | 432               | 51,758  | 情報技術                |  |
| HANNOVER RUECK SE  | 14                  | 14               | 140               | 16,774  | 金融                  |  |
| DEUTSCHE POST AG-REG                                     | 212                 | 231              | 676               | 80,975  | 資本財・サービス            |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG                                       | 41.5                | —                | —                 | —       | 金融                  |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER                                | —                   | 46               | 347               | 41,643  | 金融                  |  |
| PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE                                 | 47.5                | 50.5             | 160               | 19,222  | 一般消費財・サービス          |  |
| LANXESS AG   | 19.5                | 22               | 127               | 15,207  | 素材                  |  |
| AXEL SPRINGER SE   | —                   | 10               | 40                | 4,895   | 一般消費財・サービス          |  |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR                                    | 76.5                | 82               | 240               | 28,739  | 不動産                 |  |
| SYMRISE AG   | 28                  | 30               | 170               | 20,443  | 素材                  |  |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG                             | 5.5                 | —                | —                 | —       | 一般消費財・サービス          |  |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 4,744.07<br>49銘柄 | 5,266.57<br>56銘柄  | 23,221  | 2,779,621<br><3.5%> |  |
| <b>ユーロ (ポルトガル)</b>                                       |                     |                  |                   |         |                     |  |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 658.5<br>3銘柄     | 658.5<br>3銘柄      | 350     | 41,895<br><0.1%>    |  |
| <b>ユーロ (スペイン)</b>  |                     |                  |                   |         |                     |  |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 11,544.1<br>25銘柄 | 14,011.03<br>26銘柄 | 7,752   | 928,014<br><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                |            |  |
| <b>ユーロ (イタリア)</b>            |                          |                        |                        |                   |            |  |
| 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<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 12,601.53<br>21 銘柄     | 14,083.72<br>19 銘柄     | 4,205<br><0.6%>   | 503,378    |  |
| <b>ユーロ (フィンランド)</b>          |                          |                        |                        |                   |            |  |
| 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<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 1,460.5<br>12 銘柄       | 2,077<br>12 銘柄         | 2,432<br><0.4%>   | 291,203    |  |
| <b>ユーロ (オーストリア)</b>          |                          |                        |                        |                   |            |  |
| 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<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 159.5<br>5 銘柄          | 170.5<br>5 銘柄          | 496<br><0.1%>     | 59,455     |  |
| <b>ユーロ (その他)</b>             |                          |                        |                        |                   |            |  |
| 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<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 137<br>1 銘柄            | 205<br>2 銘柄            | 305<br><0.0%>     | 36,512     |  |
| ユ ー ロ 通 貨 計                  | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 49,132.57<br>222 銘柄    | 54,940<br>232 銘柄       | 76,154<br><11.5%> | 9,115,717  |  |
| フ ァ ン ド 合 計                  | 株 数、金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 283,613.45<br>1,201 銘柄 | 291,354.98<br>1,238 銘柄 | —<br><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<br>□ 数            | 当<br>□ 数        | 期末<br>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                |
| <b>(アメリカ)</b>                |                      |                 |                   |                   |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 221.678<br>34銘柄 | 258.378<br>36銘柄   | 13,590<br><1.9% > |
| <b>(カナダ)</b>                 |                      |                 |                   |                   |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | —<br>—          | 7.8<br>3銘柄        | 201<br><0.0% >    |
| <b>(オーストラリア)</b>             |                      |                 |                   |                   |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 481.401<br>8銘柄  | 498.401<br>8銘柄    | 2,256<br><0.2% >  |
| <b>(香港)</b>                  |                      |                 |                   |                   |
| LINK REIT                    | 49.5                 | 52              | 2,750             | 39,886            |
| 香港ドル通貨計                      | □ 数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 49.5<br>1銘柄     | 52<br>1銘柄         | 2,750<br><0.1% >  |
| <b>(シンガポール)</b>              |                      |                 |                   |                   |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 111.2<br>2銘柄    | 164.2<br>3銘柄      | 320<br><0.0% >    |
| <b>(イギリス)</b>                |                      |                 |                   |                   |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 93.25<br>5銘柄    | 98.75<br>5銘柄      | 546<br><0.1% >    |
| <b>ユーロ (フランス)</b>            |                      |                 |                   |                   |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 8.55<br>5銘柄     | 10.01<br>5銘柄      | 902<br><0.1% >    |
| 合計                           | □ 数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 965.579<br>55銘柄 | 1,089.539<br>61銘柄 | —<br><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<br>1,114 | 百万円<br>— |

(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<br>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<br>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。）<br>2. 新興国の企業のDR（預託証券）<br>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。<br>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。<br>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%<br>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%<br>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。<br>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。<br>※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。<br>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。<br>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。<br>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<br>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<br>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<br>12,158 | 円<br>0 | %<br>21.6 | %<br>94.7 | %<br>1.1 | %<br>3.0   | 百万円<br>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。

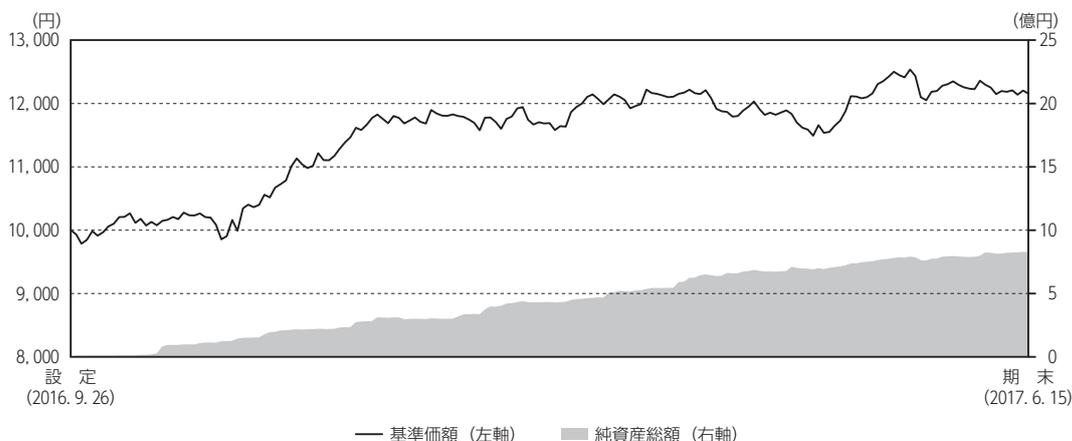
(注2) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(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<br>10,000 | %<br>— | %<br>— | %<br>— | %<br>—     |
| 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<br>～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<br>(2016. 9. 26~2017. 6. 15) |         | 項目の概要  |
|----------------|---------------------------------|---------|--|
|                | 金額                              | 比率      |  |
| <b>信託報酬</b>    | 37円                             | 0.323%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>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                                     |
| <b>売買委託手数料</b> | 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<br>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) |  |
| <b>有価証券取引税</b> | 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<br>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) |  |
| <b>その他費用</b>   | 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   |
| <b>合計</b>      | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 23,362.17<br>21銘柄 | 2,392<br>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<br>銘柄数 < 比率 > | 79,149<br>76銘柄 | 58,007<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 23,387.14<br>47銘柄 | 111,186<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 2,132.66<br>14銘柄  | 2,200<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 8,705.32<br>14銘柄  | 23,239<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 11,366.94<br>9銘柄 | 152,986<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 3,071.68<br>35銘柄 | 125,275<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 10,030<br>10銘柄   | 6,873,957<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 5,730.06<br>41銘柄 | 10,463<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 3,577<br>14銘柄    | 3,011<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 2,833.72<br>39銘柄    | 28,386 | 246,960   | <8.1%>     |
| (タイ)                         | 株数                  | 千タイ・バーツ             |        | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 5,452<br>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<br>銘柄数 < 比率 > | 879.7<br>9銘柄        | 2,245  | 65,848    | <2.2%>     |
| ファンド合計                       | 株数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 179,677.39<br>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                           | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 65<br>1銘柄     | 1,292<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 22.5<br>1銘柄   | 780<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 53.21<br>2銘柄  | 892<br><0.3%>   |
| 合計                           | 口数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 140.71<br>4銘柄 | —<br><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。

# 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ないます。  |
| 主要投資対象 | 1. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 (上場予定および店頭登録予定を含みます)<br>2. 新興国の企業のDR (預託証券)<br>3. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF (上場投資信託証券)   |
| 運用方法   | ①主として、新興国の株式 (DRを含みます。以下同じ。) (※) に投資し、投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。<br>※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。<br>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。<br>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。<br>④為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。 |
| 株式組入制限 | 無制限   |

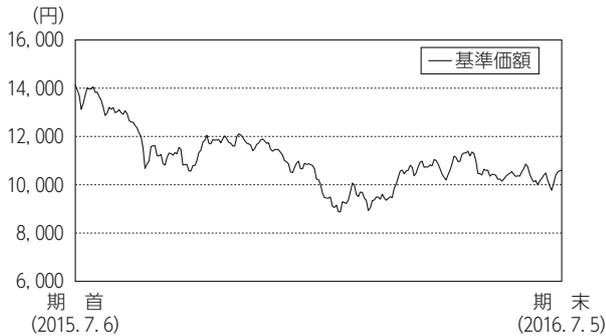
## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

### ■当期中の基準価額と市況の推移



### 《運用経過》

#### ◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：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まる形となり、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。

■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。

■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<br>319<br>( )           | 千アメリカ・ドル<br>150<br>( )        | 百株<br>689.86     | 千アメリカ・ドル<br>388        |
|       | 香港                     | 百株<br>10,619<br>( 141.66)  | 千香港ドル<br>6,137<br>(△ 5)       | 百株<br>2,803.66   | 千香港ドル<br>1,329         |
|       | 台湾                     | 百株<br>1,790<br>( 258.91)   | 千台湾ドル<br>7,265<br>( 218)      | 百株<br>2,576.3    | 千台湾ドル<br>10,164        |
|       | トルコ                    | 百株<br>129<br>( )           | 千トルコ・リラ<br>91<br>( )          | 百株<br>14.3       | 千トルコ・リラ<br>69          |
|       | メキシコ                   | 百株<br>698<br>( 127.86)     | 千メキシコ・ペソ<br>1,073<br>( )      | 百株<br>282.85     | 千メキシコ・ペソ<br>777        |
|       | チリ                     | 百株<br>458.6<br>( 1,765.18) | 千チリ・ペソ<br>30,327<br>( )       | 百株<br>101        | 千チリ・ペソ<br>31,271       |
|       | インド                    | 百株<br>779.8<br>( 19.2)     | 千インド・ルピー<br>13,415<br>( )     | 百株<br>294.8      | 千インド・ルピー<br>5,234      |
|       | インドネシア                 | 百株<br>620<br>( )           | 千インドネシア・ルピア<br>354,334<br>( ) | 百株<br>889        | 千インドネシア・ルピア<br>452,817 |
|       | ブラジル                   | 百株<br>2,459<br>( 104.51)   | 千ブラジル・レアル<br>3,299<br>(△ 2)   | 百株<br>681.6      | 千ブラジル・レアル<br>552       |
|       | マレーシア                  | 百株<br>562<br>( 60)         | 千マレーシア・リンギット<br>372<br>( )    | 百株<br>443        | 千マレーシア・リンギット<br>239    |
|       | 南アフリカ                  | 百株<br>473.5<br>( 18.4)     | 千南アフリカ・ランド<br>4,377<br>( )    | 百株<br>180.4      | 千南アフリカ・ランド<br>1,873    |
|       | タイ                     | 百株<br>307<br>( )           | 千タイ・バーツ<br>2,320<br>( )       | 百株<br>208        | 千タイ・バーツ<br>723         |
| ポーランド | 百株<br>117.8<br>( 24.3) | 千ポーランド・ズロチ<br>129<br>( )   | 百株<br>90.9                    | 千ポーランド・ズロチ<br>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<br>78<br>( )   | 千アメリカ・ドル<br>1,183<br>( ) | 千口<br>46<br>( ) | 千アメリカ・ドル<br>683<br>( ) |
|     | メキシコ  | 千口<br>6.7<br>( )  | 千メキシコ・ペソ<br>260<br>(△ 2) | 千口<br>—<br>( )  | 千メキシコ・ペソ<br>—<br>( )   |
| 国   | 南アフリカ | 千口<br>5.97<br>( ) | 千南アフリカ・ランド<br>101<br>( ) | 千口<br>—<br>( )  | 千南アフリカ・ランド<br>—<br>( ) |

(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。

■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  |
|                                     | 千株   | 千円     | 円     |                                     | 千株     | 千円     | 円     |
| 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  |
|                                     | 千口   | 千円      | 円     |                                     | 千口  | 千円     | 円     |
| 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     | 期 首 |          | 当 期      |         | 期 末 |            | 業 種 等 |
|------------------------------|-------------|---------|-----|----------|----------|---------|-----|------------|-------|
|                              |             |         | 株 数 | 株 数      | 評 価      | 額       |     |            |       |
|                              |             |         | 株 数 | 株 数      | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |     |            |       |
|                              |             |         | 百株  | 百株       | 千アメリカ・ドル | 千円      |     |            |       |
| <b>(アメリカ)</b>                |             |         |     |          |          |         |     |            |       |
| SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF   | 90          |         |     | 60       | 36       | 3,695   |     | その他        |       |
| MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR    | 84.5        |         |     | 88.5     | 74       | 7,593   |     | 電気通信サービス   |       |
| VTB BANK JSC -GDR-REG S      | 359.5       |         |     | 255.74   | 52       | 5,373   |     | 金融         |       |
| TATNEFT PAO-SPONSORED ADR    | 16.6        |         |     | 14.9     | 45       | 4,682   |     | エネルギー      |       |
| SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR        | 80.8        |         |     | 49       | 25       | 2,568   |     | エネルギー      |       |
| MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR  | 28.9        |         |     | 39.1     | 54       | 5,584   |     | 素材         |       |
| SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR | 25.9        |         |     | 17.8     | 14       | 1,448   |     | 電気通信サービス   |       |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS    | 6.2         |         |     | 7.5      | 25       | 2,595   |     | 生活必需品      |       |
| MEGAFON-REG S GDR            | 9.5         |         |     | 10.8     | 11       | 1,205   |     | 電気通信サービス   |       |
| URALKALI PJSC-SPON GDR-REG S | 9.6         |         |     | —        | —        | —       |     | 素材         |       |
| SBERBANK PAO -SPONSORED ADR  | 436.7       |         |     | 294.8    | 262      | 26,834  |     | 金融         |       |
| NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S  | 3.9         |         |     | 2.9      | 29       | 3,034   |     | エネルギー      |       |
| LUKOIL PJSC-SPON ADR         | 73.5        |         |     | 75.9     | 326      | 33,417  |     | エネルギー      |       |
| ROSNEFT OJSC-REG S GDR       | 175.8       |         |     | 153.3    | 79       | 8,107   |     | エネルギー      |       |
| GAZPROM PAO -SPON ADR        | 888.7       |         |     | 734      | 321      | 32,876  |     | エネルギー      |       |
| SEVERSTAL - GDR REG S        | 12.5        |         |     | 12.5     | 13       | 1,378   |     | 素材         |       |
| INNER MONGOLIA YITAI COAL-B  | —           |         |     | 115      | 8        | 917     |     | エネルギー      |       |
| アメリカ・ドル通貨計                   | 株 数、金 額     | 2,302.6 |     | 1,931.74 | 1,380    | 141,312 |     |            |       |
|                              | 銘柄 数 < 比率 > | 16 銘柄   |     | 16 銘柄    |          | <9.3%>  |     |            |       |
| <b>(香港)</b>                  |             |         |     |          |          |         |     |            |       |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H | 140         |         |     | 140      | 133      | 1,757   |     | 資本財・サービス   |       |
| BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS | 210         |         |     | 330      | 148      | 1,960   |     | 一般消費財・サービス |       |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H    | 250         |         |     | 250      | 144      | 1,910   |     | 資本財・サービス   |       |
| CHINA MERCHANTS HLDGS INTL   | 40          |         |     | 60       | 123      | 1,631   |     | 資本財・サービス   |       |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | —           |         |     | 200      | 85       | 1,132   |     | 一般消費財・サービス |       |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDIN  | 100         |         |     | 120      | 198      | 2,623   |     | 生活必需品      |       |
| JIANGXI COPPER CO LTD-H      | 110         |         |     | 120      | 112      | 1,479   |     | 素材         |       |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 2,718       |         |     | 2,518    | 1,415    | 18,679  |     | エネルギー      |       |
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS    | 20          |         |     | 25       | 113      | 1,498   |     | 資本財・サービス   |       |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H  | 140         |         |     | 160      | 132      | 1,744   |     | 一般消費財・サービス |       |
| GOME ELECTRICAL APPLIANCES   | 1,160       |         |     | 1,000    | 93       | 1,227   |     | 一般消費財・サービス |       |
| FOSUN INTERNATIONAL LTD      | —           |         |     | 75       | 76       | 1,005   |     | 資本財・サービス   |       |
| TENCENT HOLDINGS LTD         | 17          |         |     | 21       | 375      | 4,959   |     | 情報技術       |       |
| CHINA TELECOM CORP LTD-H     | 1,040       |         |     | 1,180    | 417      | 5,513   |     | 電気通信サービス   |       |
| SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD   | —           |         |     | 160      | 97       | 1,290   |     | 一般消費財・サービス |       |
| CHINA UNICOM HONG KONG LTD   | 360         |         |     | 480      | 389      | 5,138   |     | 電気通信サービス   |       |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD | 80          |         |     | 115      | 115      | 1,521   |     | 金融         |       |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 100         |         |     | 140      | 160      | 2,117   |     | 公益事業       |       |
| PETROCHINA CO LTD-H          | 1,100       |         |     | 1,560    | 834      | 11,016  |     | エネルギー      |       |
| DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD   | —           |         |     | 90       | 52       | 698     |     | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 32,019<br>57銘柄 | 39,976<br>70銘柄 | 24,492 | 323,302<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 13,680.96<br>54銘柄 | 13,153.57<br>50銘柄 | 51,500<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 915.16<br>14銘柄    | 1,029.86<br>14銘柄  | 791<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 3,591.13<br>14銘柄  | 4,134.14<br>13銘柄  | 8,679<br><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                           | 期首         |          | 期末        |         | 業種等        |
|------------------------------|------------|----------|-----------|---------|------------|
|                              | 株数         | 株数       | 評価額       | 価額      |            |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 5,209.88<br>47銘柄 | 7,091.79<br>45銘柄 | 10,640        | 333,159<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 1,702<br>17銘柄    | 1,881<br>16銘柄    | 1,375         | 35,159<br><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<br>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<br>銘柄数 < 比率 > | 1,313.14<br>35 銘柄   | 1,624.64<br>36 銘柄   | 15,616 | 109,630<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 1,963<br>15 銘柄      | 2,062<br>14 銘柄      | 11,472 | 33,498<br><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<br>銘柄数 < 比率 > | 261.2<br>8 銘柄       | 312.4<br>7 銘柄       | 754    | 19,388<br><1.3%>     |  |
| ファンド合計                       | 株数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 76,086.27<br>330 銘柄 | 88,683.32<br>337 銘柄 | —      | 1,374,594<br><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<br>□ 数           | 当<br>□ 数             | 期末<br>評 価 額             |                      |
|--|---------------------|----------------------|-------------------------|----------------------|
|  |                     |                      | 外貨建金額                   | 邦貨換算金額               |
| (アメリカ)<br>POWERSHARES FTSE RAFI EM MKT                           | 千口<br>25            | 千口<br>57             | 千アメリカ・ドル<br>939         | 千円<br>96,239         |
| アメリカ・ドル通貨計   | □ 数、金額<br>25        | □ 数、金額<br>57         | 939                     | 96,239               |
|  | 銘柄数 < 比率 >          | 1 銘柄                 |                         | < 6.4% >             |
| (メキシコ)<br>FIBRA UNO ADMINISTRACION SA                            | 千口<br>—             | 千口<br>6.7            | 千メキシコ・ペソ<br>260         | 千円<br>1,444          |
| メキシコ・ペソ通貨計   | □ 数、金額<br>—         | □ 数、金額<br>6.7        | 260                     | 1,444                |
|  | 銘柄数 < 比率 >          | 1 銘柄                 |                         | < 0.1% >             |
| (南アフリカ)<br>REDEFINE PROPERTIES LTD<br>GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 千口<br>12.74<br>8.76 | 千口<br>16.42<br>11.05 | 南アフリカ・ランド<br>188<br>282 | 千円<br>1,322<br>1,983 |
| 南アフリカ・ランド通貨計   | □ 数、金額<br>21.5      | □ 数、金額<br>27.47      | 470                     | 3,305                |
|  | 銘柄数 < 比率 >          | 2 銘柄                 |                         | < 0.2% >             |
| 合 計  | □ 数、金額<br>46.5      | □ 数、金額<br>91.17      | —                       | 100,989              |
|  | 銘柄数 < 比率 >          | 3 銘柄                 |                         | < 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<br>1,374,594 | %<br>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-1'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<br>(ベンチマーク) |            | 公社債<br>組入比率 | 債券<br>先物比率 | 純資産<br>総額     |
|-----------------|------------|-----------|------------|---------------------------------------|------------|-------------|------------|---------------|
|                 | 税込み<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | 期中<br>騰落率  | 期中<br>騰落率                             | 期中<br>騰落率  |             |            |               |
| 1期末(2017年6月15日) | 円<br>9,858 | 円<br>0    | %<br>△ 1.4 | 521.587                               | %<br>△ 1.3 | %<br>99.4   | %<br>—     | 百万円<br>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<br>(DBI) 総合指数 |            | 公 社 債<br>組入比率 | 債 券<br>先物比率 |
|------------------|---------|------------|------------------------------|------------|---------------|-------------|
|                  | 円       | 騰 落 率<br>% | (ベンチマーク)                     | 騰 落 率<br>% |               |             |
| (設定) 2016年 9月26日 | 10,000  | —          | (9/23)<br>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

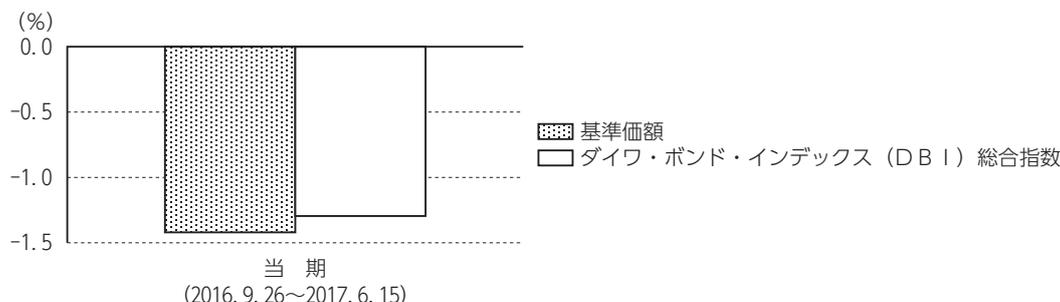
当ファンドの騰落率が、ベンチマーク（ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数）の騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行ないました。期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行ないました。

## 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<br>～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<br>(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<br>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<br>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<br>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<br>千口   | 金額<br>千円   | 口数<br>千口 | 金額<br>千円 |
| 日本債券<br>インデックス<br>マザーファンド | 10,475,360 | 14,580,909 | 249,036  | 346,287  |

(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<br>A | うち利害<br>関係人との<br>取引状況<br>B | B/A | 売付額等<br>C | うち利害<br>関係人との<br>取引状況<br>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<br>千口   | 評価額<br>千円  |
| 日本債券インデックス<br>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<br>マザーファンド | 14,234,020<br>千円 | 99.8<br>% |
| 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<br>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      |
|              | 51 地方公共団体       | 0.8410 % | 100,000 <sup>千円</sup> | 104,479 <sup>千円</sup> | 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 リソな銀行劣後       | 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  |

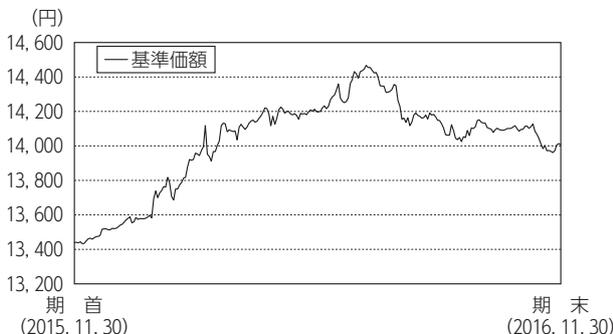
## 大和投資信託

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         |      |      |
|-------------|------------|------------|------|------------|-----------|------|------|
|             | 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 |
| 区 分         | 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<br>銘 柄 | 年 利 率<br>% | 末             |             | 償還年月日      |
|-----|------------|------------|---------------|-------------|------------|
|     |            |            | 額 面 金 額<br>千円 | 評 価 額<br>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<br>銘 柄 | 年 利 率<br>% | 末             |             | 償還年月日      |
|-----|------------|------------|---------------|-------------|------------|
|     |            |            | 額 面 金 額<br>千円 | 評 価 額<br>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<br>銘 柄 | 年 利 率<br>% | 末             |             |            |
|-----|------------|------------|---------------|-------------|------------|
|     |            |            | 額 面 金 額<br>千円 | 評 価 額<br>千円 | 償還年月日      |
|     | 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。<br>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。<br>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

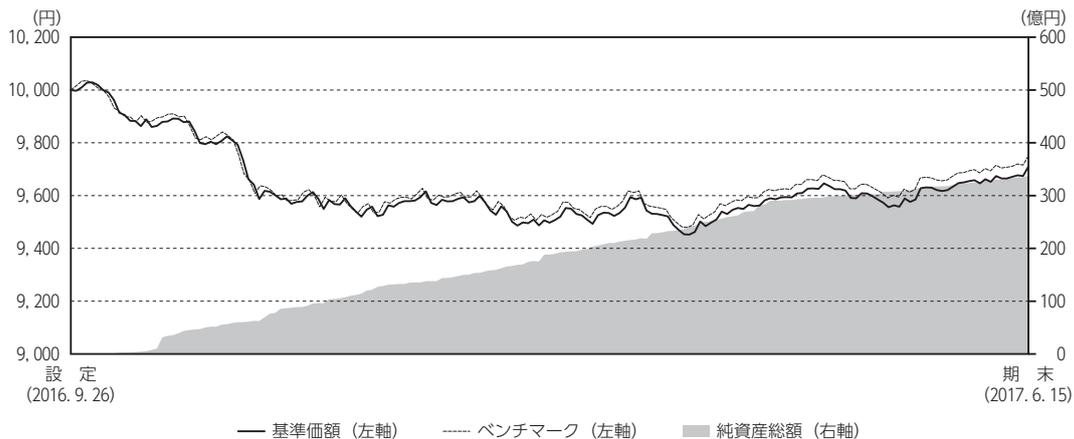
| 決算期                | 基準価額       |            |            | シティ世界国債インデックス<br>(除く日本、円ヘッジ・円ベース)<br>(ベンチマーク) |            | 公社債<br>組入比率 | 債券<br>先物比率 | 純資産<br>総額     |
|--------------------|------------|------------|------------|---|------------|-------------|------------|---------------|
|           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

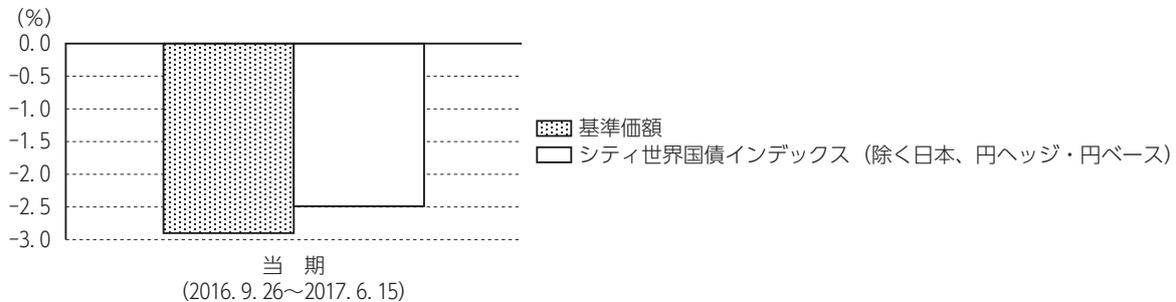
外貨建て資産については為替ヘッジを行ない、またファンドとベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース））の金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

## 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<br>～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<br>(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<br>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<br>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<br>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<br>(為替ヘッジあり)<br>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<br>(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<br>(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                  |
|--------------------------|------------------------|
| <b>(A) 資産</b>            | <b>33,846,999,490円</b> |
| 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>(B) 負債</b>            | <b>101,895,397</b>     |
| 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                |
| <b>(C) 純資産総額 (A - B)</b> | <b>33,745,104,093</b>  |
| 元本                       | 34,752,986,225         |
| 次期繰越損益金                  | △ 1,007,882,132        |
| <b>(D) 受益権総口数</b>        | <b>34,752,986,225口</b> |
| 1万口当り基準価額 (C / D)        | <b>9,710円</b>          |

\* 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                    |
|------------------------------|------------------------|
| <b>(A) 配当等収益</b>             | <b>△ 23,355円</b>       |
| 受取利息                         | 1,043                  |
| 支払利息                         | △ 24,398               |
| <b>(B) 有価証券売買損益</b>          | <b>400,383,358</b>     |
| 売買益                          | 403,938,479            |
| 売買損                          | △ 3,555,121            |
| <b>(C) 信託報酬等</b>             | <b>△ 54,434,917</b>    |
| <b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b> | <b>345,925,086</b>     |
| <b>(E) 追加信託差損益金</b>          | <b>△ 1,353,807,218</b> |
| (配当等相当額)                     | (△ 14,068)             |
| (売買損益相当額)                    | (△ 1,353,793,150)      |
| <b>(F) 合計 (D + E)</b>        | <b>△ 1,007,882,132</b> |
| <b>次期繰越損益金 (F)</b>           | <b>△ 1,007,882,132</b> |
| 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。<br>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。<br>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   |

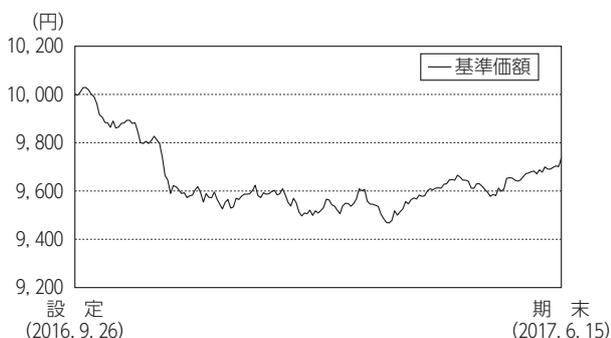
## 大和投資信託

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



| 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。

### 《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。

### ■1万口当りの費用の明細

| 項目                       | 当 期               |
|--------------------------|-------------------|
| 売買委託手数料<br>(先物)          | 1円<br>( 1)        |
| 有価証券取引税                  | —                 |
| その他費用<br>(保管費用)<br>(その他) | 3<br>( 3)<br>( 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<br>140,556    | 千アメリカ・ドル<br>10,938<br>( — ) |                            |
|   | カナダ     | 千カナダ・ドル<br>8,878       | 千カナダ・ドル<br>915<br>( — )     |                            |
|   | オーストラリア | 千オーストラリア・ドル<br>8,307   | 千オーストラリア・ドル<br>29<br>( — )  |                            |
|   | シンガポール  | 千シンガポール・ドル<br>1,509    | 千シンガポール・ドル<br>—<br>( — )    |                            |
|   | イギリス    | 千イギリス・ポンド<br>16,472    | 千イギリス・ポンド<br>—<br>( — )     |                            |
|   | スイス     | 千スイス・フラン<br>421        | 千スイス・フラン<br>—<br>( — )      |                            |
|   | デンマーク   | 千デンマーク・クローネ<br>11,484  | 千デンマーク・クローネ<br>—<br>( — )   |                            |
|   | ノルウェー   | 千ノルウェー・クローネ<br>6,312   | 千ノルウェー・クローネ<br>—<br>( — )   |                            |
|   | スウェーデン  | 千スウェーデン・クローネ<br>10,384 | 千スウェーデン・クローネ<br>—<br>( — )  |                            |
|   | 国       | メキシコ                   | 千メキシコ・ペソ<br>46,073          | 千メキシコ・ペソ<br>—<br>( — )     |
|   |         | マレーシア                  | 千マレーシア・リンギット<br>4,017       | 千マレーシア・リンギット<br>—<br>( — ) |
|   |         | 南アフリカ                  | 千南アフリカ・ランド<br>18,738        | 千南アフリカ・ランド<br>—<br>( — )   |
|   |         | ポーランド                  | 千ポーランド・ズロチ<br>6,700         | 千ポーランド・ズロチ<br>—<br>( — )   |
|   |         | ユーロ<br>(アイルランド)        | 千ユーロ<br>1,993               | 千ユーロ<br>—<br>( — )         |

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

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

(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<br>35,245 | 百万円<br>33,932 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

(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<br>以下組入<br>比 率 | 残存期間別組入比率 |         |         |
|                 |                       |                        | 外 貨 建 金 額        | 邦 貨 換 算 金 額 |      |                      | 5 年 以 上   | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| アメリカ            | 千アメリカ・ドル<br>127,503   | 千アメリカ・ドル<br>130,461    | 千円<br>14,314,191 | 41.4 %      | — %  | 17.9 %               | 16.1 %    | 7.3 %   |         |
| カナダ             | 千カナダ・ドル<br>7,247      | 千カナダ・ドル<br>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<br>7,622  | 千オーストラリア・ドル<br>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<br>1,437   | 千シンガポール・ドル<br>1,514    | 120,713          | 0.3         | —    | 0.2                  | 0.1       | 0.0     |         |
| イギリス            | 千イギリス・ポンド<br>12,858   | 千イギリス・ポンド<br>16,819    | 2,353,159        | 6.8         | —    | 4.8                  | 1.7       | 0.3     |         |
| スイス             | 千スイス・フラン<br>352       | 千スイス・フラン<br>416        | 47,099           | 0.1         | —    | 0.0                  | 0.1       | —       |         |
| デンマーク           | 千デンマーク・クローネ<br>9,040  | 千デンマーク・クローネ<br>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<br>5,920  | 千ノルウェー・クローネ<br>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<br>8,800 | 千スウェーデン・クローネ<br>10,342 | 130,423          | 0.4         | —    | 0.2                  | 0.2       | —       |         |
| メキシコ            | 千メキシコ・ペソ<br>44,610    | 千メキシコ・ペソ<br>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<br>4,100 | 千マレーシア・リンギット<br>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<br>20,130  | 千南アフリカ・ランド<br>19,026   | 165,533          | 0.5         | —    | 0.4                  | 0.1       | —       |         |
| ポーランド           | 千ポーランド・ズロチ<br>6,645   | 千ポーランド・ズロチ<br>6,797    | 199,384          | 0.6         | —    | 0.2                  | 0.3       | 0.1     |         |
| ユーロ<br>(アイルランド) | 千ユーロ<br>1,698         | 千ユーロ<br>1,999          | 246,160          | 0.7         | —    | 0.4                  | 0.3       | —       |         |
| ユーロ<br>(オランダ)   | 千ユーロ<br>4,942         | 千ユーロ<br>5,905          | 726,998          | 2.1         | —    | 1.4                  | 0.4       | 0.3     |         |
| ユーロ<br>(ベルギー)   | 千ユーロ<br>5,890         | 千ユーロ<br>6,826          | 840,362          | 2.4         | —    | 1.9                  | 0.4       | 0.2     |         |
| ユーロ<br>(フランス)   | 千ユーロ<br>21,646        | 千ユーロ<br>26,637         | 3,279,393        | 9.5         | —    | 5.8                  | 3.0       | 0.6     |         |
| ユーロ<br>(ドイツ)    | 千ユーロ<br>15,919        | 千ユーロ<br>19,072         | 2,348,025        | 6.8         | —    | 4.2                  | 2.1       | 0.6     |         |
| ユーロ<br>(スペイン)   | 千ユーロ<br>12,890        | 千ユーロ<br>14,821         | 1,824,649        | 5.3         | —    | 3.1                  | 1.8       | 0.4     |         |
| ユーロ<br>(イタリア)   | 千ユーロ<br>21,536        | 千ユーロ<br>25,648         | 3,157,614        | 9.1         | —    | 5.6                  | 2.9       | 0.6     |         |
| ユーロ<br>(フィンランド) | 千ユーロ<br>1,280         | 千ユーロ<br>1,465          | 180,380          | 0.5         | —    | 0.4                  | 0.1       | —       |         |
| ユーロ<br>(オーストリア) | 千ユーロ<br>3,350         | 千ユーロ<br>3,919          | 482,551          | 1.4         | —    | 0.9                  | 0.3       | 0.2     |         |
| ユーロ<br>(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   |            |       |
| アメリカ | United States Treasury Note/Bond | 国債証券 | 2.6250 % | 千アメリカ・ドル<br>5,120 | 千アメリカ・ドル<br>5,306 | 千円<br>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<br>金 額                           | 40銘柄 |        | 127,503     | 130,461     | 14,314,191  |            |
| <b>カナダ</b>     |                                      |      |        | 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<br>金 額                           | 15銘柄 |        | 7,247       | 7,984       | 661,849     |            |
| <b>オーストラリア</b> |                                      |      |        | 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<br>金 額                           | 16銘柄 |        | 7,622       | 8,346       | 695,073     |            |
| <b>シンガポール</b>  |                                      |      |        | 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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>260 | 千マレーシア・リンギット<br>264 | 千円<br>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<br>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<br>1,210 | 千南アフリカ・ランド<br>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<br>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<br>200   | 千ポーランド・ズロチ<br>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<br>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<br>290         | 千ユーロ<br>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<br>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<br>280         | 千ユーロ<br>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<br>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<br>350         | 千ユーロ<br>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<br>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<br>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<br>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<br>金 額                        | 18銘柄  |        | 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<br>金 額                        | 26銘柄  |        | 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<br>金 額                        | 8銘柄   |        | 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<br>金 額                        | 14銘柄  |        | 3,350   | 3,919     | 482,551     |            |
| 通貨小計        | 銘柄数<br>金 額                        | 154銘柄 |        | 89,151  | 106,296   | 13,086,136  |            |
| 合 計         | 銘柄数<br>金 額                        | 322銘柄 |        |         |           | 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。<br>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

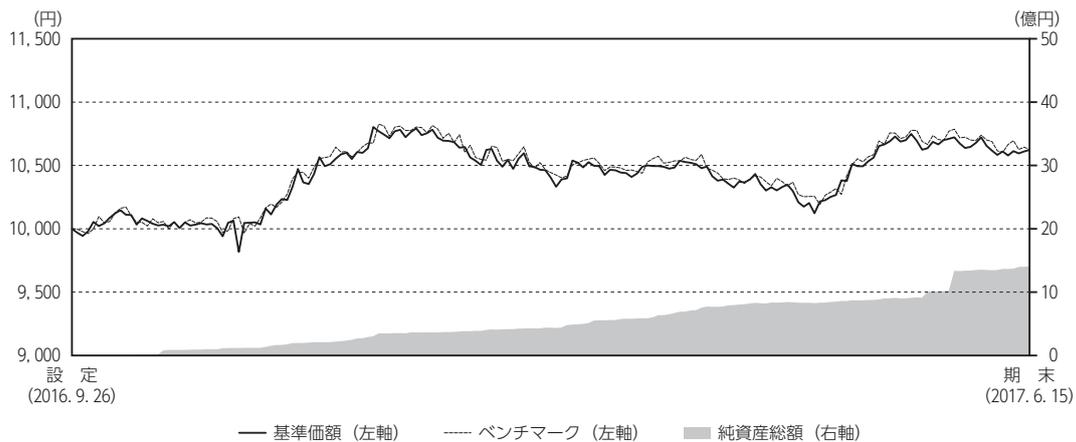
| 決算期             | 基準価額        |           |           | シティ世界国債インデックス<br>(除く日本、ヘッジなし・円ベース)<br>(ベンチマーク) |             | 公社債<br>組入比率 | 債券<br>先物比率 | 純資産<br>総額    |
|-----------------|-------------|-----------|-----------|--|-------------|-------------|------------|--------------|
|                 | 税込み<br>分配金  | 期中<br>騰落率 | 期中<br>騰落率 | 期中<br>騰落率                                      |             |             |            |              |
| 1期末(2017年6月15日) | 円<br>10,622 | 円<br>0    | %<br>6.2  | %<br>6.3                                       | %<br>10,625 | %<br>98.8   | %<br>—     | 百万円<br>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<br>(除く日本、ヘッジなし・円ベース) |       | 公 社 債<br>組入比率 | 債 券<br>先物比率 |
|------------------|---------|-------|------------------------------------|-------|---------------|-------------|
|                  | 騰 落 率   | 騰 落 率 | (ベンチマーク)                           | 騰 落 率 |               |             |
| (設定) 2016年 9月26日 | 円       | %     | (9/23)                             | %     | %             | %           |
|                  | 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。

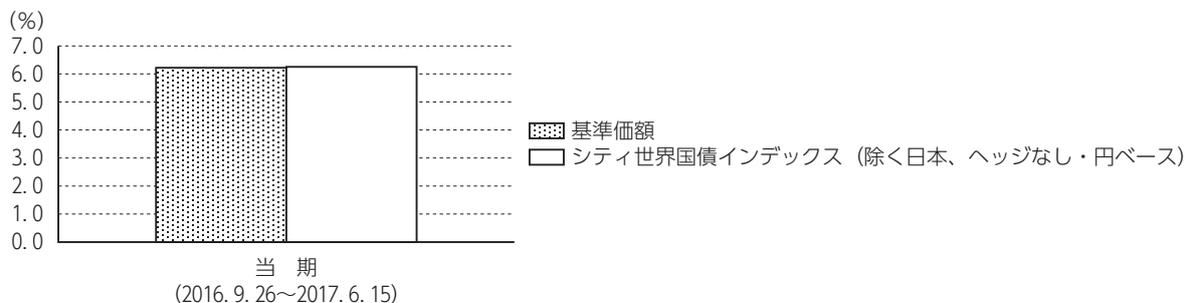
### ■ 外国債券インデックスマザーファンド

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<br>～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<br>(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<br>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<br>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<br>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<br>607, 595 | United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.625% 2017/8/31 | 千円<br>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<br>616,458    | 千アメリカ・ドル<br>630,197    | 千円<br>69,145,298 | 43.4 | —          | 18.1      | 17.5 | 7.7  |
| カナダ         | 千カナダ・ドル<br>35,945      | 千カナダ・ドル<br>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<br>37,481  | 千オーストラリア・ドル<br>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<br>7,388    | 千シンガポール・ドル<br>7,792    | 621,067          | 0.4  | —          | 0.2       | 0.1  | 0.1  |
| イギリス        | 千イギリス・ポンド<br>62,478    | 千イギリス・ポンド<br>81,304    | 11,375,352       | 7.1  | —          | 5.2       | 1.5  | 0.4  |
| スイス         | 千スイス・フラン<br>2,187      | 千スイス・フラン<br>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<br>46,136  | 千デンマーク・クローネ<br>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<br>32,177  | 千ノルウェー・クローネ<br>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<br>51,650 | 千スウェーデン・クローネ<br>59,476 | 749,994          | 0.5  | —          | 0.2       | 0.2  | 0.1  |
| メキシコ        | 千メキシコ・ペソ<br>232,260    | 千メキシコ・ペソ<br>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<br>26,234 | 千マレーシア・リンギット<br>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<br>111,523  | 千南アフリカ・ランド<br>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<br>34,924   | 千ポーランド・ズロチ<br>35,860   | 1,051,779        | 0.7  | —          | 0.3       | 0.3  | 0.1  |
| ユ<br>ー<br>ロ | 千ユーロ<br>8,886          | 千ユーロ<br>10,245         | 1,261,318        | 0.8  | —          | 0.4       | 0.3  | 0.1  |
|             | 千ユーロ<br>23,198         | 千ユーロ<br>27,911         | 3,436,219        | 2.2  | —          | 1.5       | 0.5  | 0.2  |
|             | 千ユーロ<br>26,687         | 千ユーロ<br>33,011         | 4,064,045        | 2.5  | —          | 1.9       | 0.5  | 0.2  |
|             | 千ユーロ<br>106,359        | 千ユーロ<br>127,216        | 15,661,641       | 9.8  | —          | 6.2       | 2.7  | 0.9  |
|             | 千ユーロ<br>78,046         | 千ユーロ<br>92,879         | 11,434,422       | 7.2  | —          | 4.2       | 1.9  | 1.0  |
|             | 千ユーロ<br>61,348         | 千ユーロ<br>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<br>108,029 | 千ユーロ<br>123,743 | 15,234,010 | 9.6        | —         | 5.7  | 2.8  | 1.1 |
|      | フィンランド | 千ユーロ<br>6,988   | 千ユーロ<br>7,840   | 965,222    | 0.6        | —         | 0.4  | 0.2  | 0.0 |
|      | オーストリア | 千ユーロ<br>15,683  | 千ユーロ<br>19,029  | 2,342,782  | 1.5        | —         | 0.9  | 0.4  | 0.1 |
|      | 小計     | 千ユーロ<br>435,224 | 千ユーロ<br>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<br>3,173 | 千アメリカ・ドル<br>3,275 | 千円<br>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<br>404       | 千スイス・フラン<br>511        | 千円<br>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<br>11,512 | 千デンマーク・クローネ<br>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<br>7,075  | 千ノルウェー・クローネ<br>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<br>9,095 | 千スウェーデン・クローネ<br>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<br>21,447    | 千メキシコ・ペソ<br>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<br>647   | 千マレーシア・リンギット<br>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)   |                             |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |             |            |
|              | 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)   |                             |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |             |            |
|              | 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) |                                   |       |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |             |            |
|              | 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) |                                   |       |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |             |            |
|              | 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。<br>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  |

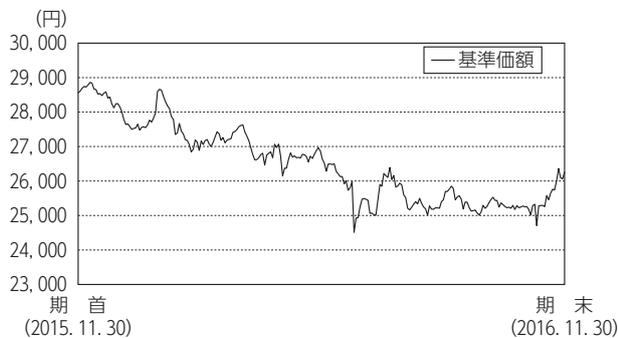
## 大和投資信託

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      | %      | 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         | —円        |
| 有価証券取引税         | —         |
| その他費用<br>(保管費用) | 7<br>( 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<br>166,210    | 千アメリカ・ドル<br>128,162<br>( —)   |
|     | カナダ     | 千カナダ・ドル<br>12,460      | 千カナダ・ドル<br>10,154<br>( —)     |
|     | オーストラリア | 千オーストラリア・ドル<br>9,620   | 千オーストラリア・ドル<br>3,697<br>( —)  |
|     | シンガポール  | 千シンガポール・ドル<br>1,829    | 千シンガポール・ドル<br>1,388<br>( —)   |
|     | イギリス    | 千イギリス・ポンド<br>8,434     | 千イギリス・ポンド<br>6,828<br>( —)    |
|     | スイス     | 千スイス・フラン<br>5,245      | 千スイス・フラン<br>5,834<br>( —)     |
|     | デンマーク   | 千デンマーク・クローネ<br>12,826  | 千デンマーク・クローネ<br>9,788<br>( —)  |
|     | ノルウェー   | 千ノルウェー・クローネ<br>7,367   | 千ノルウェー・クローネ<br>7,757<br>( —)  |
|     | スウェーデン  | 千スウェーデン・クローネ<br>12,632 | 千スウェーデン・クローネ<br>9,024<br>( —) |

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

(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<br>以下組入<br>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<br>590,540    | 千アメリカ・ドル<br>599,940    | 千円<br>67,445,295 | 43.5%      | %                  | 17.6%     | 17.7% | 8.2% |     |
| カナダ     | 千カナダ・ドル<br>34,684      | 千カナダ・ドル<br>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<br>34,514  | 千オーストラリア・ドル<br>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<br>7,037    | 千シンガポール・ドル<br>7,286    | 575,419          | 0.4        | —                  | 0.2       | 0.1   | 0.1  |     |
| イギリス    | 千イギリス・ポンド<br>62,812    | 千イギリス・ポンド<br>78,823    | 11,071,541       | 7.1        | —                  | 5.1       | 1.6   | 0.4  |     |
| スイス     | 千スイス・フラン<br>2,792      | 千スイス・フラン<br>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<br>51,791  | 千デンマーク・クローネ<br>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<br>28,227  | 千ノルウェー・クローネ<br>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<br>47,400 | 千スウェーデン・クローネ<br>55,521 | 680,141          | 0.4        | —                  | 0.3       | 0.2   | —    |     |
| メキシコ    | 千メキシコ・ペソ<br>219,416    | 千メキシコ・ペソ<br>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<br>27,216 | 千マレーシア・リンギット<br>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<br>104,423  | 千南アフリカ・ランド<br>94,587   | 766,157          | 0.5        | —                  | 0.4       | 0.1   | —    |     |
| ポーランド   | 千ポーランド・ズロチ<br>31,114   | 千ポーランド・ズロチ<br>31,602   | 852,954          | 0.6        | —                  | 0.2       | 0.3   | 0.1  |     |
| ユ       | アイルランド                 | 千ユーロ<br>8,336          | 千ユーロ<br>9,775    | 1,170,103  | 0.8                | —         | 0.4   | 0.3  | 0.1 |
|         | オランダ                   | 千ユーロ<br>25,028         | 千ユーロ<br>30,098   | 3,602,804  | 2.3                | —         | 1.4   | 0.5  | 0.3 |
| イ       | ベルギー                   | 千ユーロ<br>25,843         | 千ユーロ<br>32,303   | 3,866,730  | 2.5                | —         | 1.8   | 0.5  | 0.2 |
|         | フランス                   | 千ユーロ<br>104,489        | 千ユーロ<br>125,253  | 14,992,864 | 9.7                | —         | 6.0   | 2.8  | 0.9 |
| ロ       | ドイツ                    | 千ユーロ<br>78,396         | 千ユーロ<br>94,031   | 11,255,580 | 7.3                | —         | 4.2   | 2.2  | 0.9 |
|         | スペイン                   | 千ユーロ<br>59,673         | 千ユーロ<br>69,975   | 8,376,016  | 5.4                | —         | 3.3   | 1.5  | 0.6 |
|         | イタリア                   | 千ユーロ<br>105,758        | 千ユーロ<br>121,214  | 14,509,366 | 9.4                | —         | 5.6   | 2.9  | 0.9 |
|         | フィンランド                 | 千ユーロ<br>6,718          | 千ユーロ<br>7,626    | 912,887    | 0.6                | —         | 0.4   | 0.2  | 0.0 |
|         | オーストリア                 | 千ユーロ<br>15,749         | 千ユーロ<br>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             |               | 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 | 4.2500 | 千アメリカ・ドル<br>1,686 | 千アメリカ・ドル<br>1,740 | 千円<br>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  | 当 期 末    |           |             | 償 還 年 月 日  |
|-----|----------------------------------|------|--------|----------|-----------|-------------|------------|
|     |                                  |      |        | 額 面 金 額  | 評 価 額     |             |            |
|     |                                  |      |        |          | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 |            |
|     |                                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 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     |             | 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  | 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<br>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<br>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<br>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      | 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 |
|              |                          |      |         |         | 千円     | 千円      |            |       |        |
| 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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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   |            |
|            |     |                                   |      |        | 千ユーロ    | 千ユーロ      |             |            |
| ユーロ (イタリア) |     | ITALIAN GOVERNMENT BOND           | 国債証券 | 9.0000 | 1,106   | 1,658     | 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<br>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。<br>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。<br>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%<br>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%<br>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。<br>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。<br>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。<br>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<br>分配金  | 税引後    |          |           |        |            |
| 1期末(2017年6月15日) | 円<br>10,747 | 円<br>0 | %<br>7.5 | %<br>98.3 | %<br>— | 百万円<br>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。

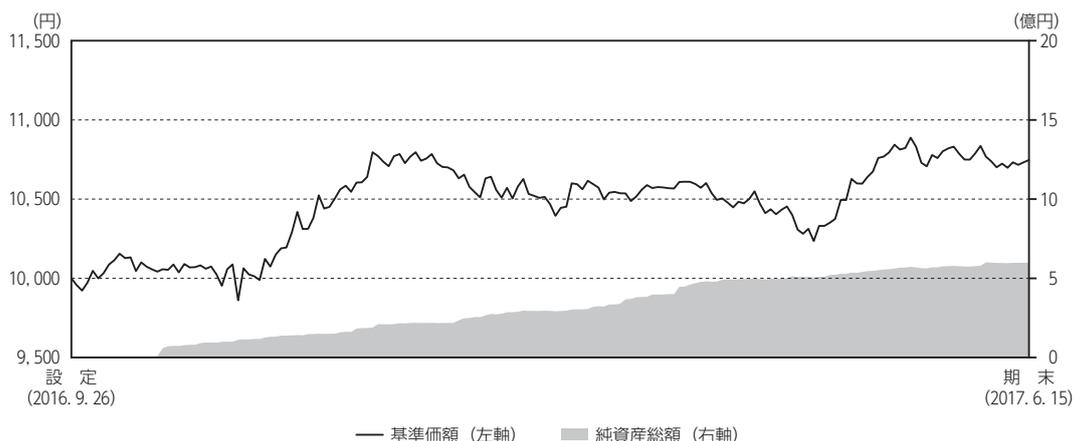
(注3) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

(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<br>組 入 比 率 | 債 券<br>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<br>～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<br>(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<br>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<br>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<br>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    |
|                        | 千口      | 千円      | 千口  | 千円    |
| ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド | 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   |
|                        | 千円      | %     |
| 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            |
|--------|-------|-------|-------|------------------|
| 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      |
| 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               |
|------------------------------|---------------------|
| <b>(A) 資産</b>                | <b>599,694,538円</b> |
| 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>(B) 負債</b>                | <b>513,129</b>      |
| 未払信託報酬                       | 503,277             |
| その他未払費用                      | 9,852               |
| <b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>     | <b>599,181,409</b>  |
| 元本                           | 557,544,250         |
| 次期繰越損益金                      | 41,637,159          |
| <b>(D) 受益権総口数</b>            | <b>557,544,250口</b> |
| 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               |
|------------------------------|-------------------|
| <b>(A) 配当等収益</b>             | <b>△ 196円</b>     |
| 受取利息                         | 3                 |
| 支払利息                         | △ 199             |
| <b>(B) 有価証券売買損益</b>          | <b>16,562,855</b> |
| 売買益                          | 16,870,170        |
| 売買損                          | △ 307,315         |
| <b>(C) 信託報酬等</b>             | <b>△ 970,654</b>  |
| <b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b> | <b>15,592,005</b> |
| <b>(E) 追加信託差損益金</b>          | <b>26,045,154</b> |
| (配当等相当額)                     | (△ 88)            |
| (売買損益相当額)                    | ( 26,045,242)     |
| <b>(F) 合計 (D + E)</b>        | <b>41,637,159</b> |
| 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    | 2017年6月15日現在 |              |           |      |                    |           |      |      |
|--------|--------------|--------------|-----------|------|--------------------|-----------|------|------|
|        | 額 面 金 額      | 評 価 額        |           | 組入比率 | うちBB格<br>以下組入<br>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<br>680           | 千トルコ・リラ<br>681           | 千円<br>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<br>9,800        | 千メキシコ・ペソ<br>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<br>5,000       | 千フィリピン・ペソ<br>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<br>3,100      | 千アルゼンチン・ペソ<br>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<br>490,000        | 千チリ・ペソ<br>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<br>90,000      | 千コロンビア・ペソ<br>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<br>3,850,000 | 千インドネシア・ルピア<br>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<br>1,660 | 千ブラジル・レアル<br>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<br>3,500  | 千チェコ・コルナ<br>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<br>430   | 千ルーマニア・レイ<br>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<br>7,880 | 千ロシア・ルーブル<br>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 |

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<br>1,030    | 千ポーランド・ズロチ<br>1,106    | 千円<br>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<br>66,300 | 千ハンガリー・フォリント<br>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買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第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。<br>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。<br>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   |

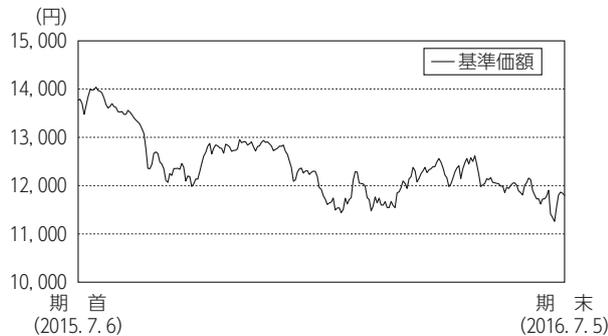
## 大和投資信託

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

(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<br>以下組入<br>率 | 残存期間別組入比率 |      |      |
|--------|---------------------------|---------------------------|---------------|------|------|--------------------|-----------|------|------|
|        |                           | 評 価 額                     |               | %    |      |                    | 5年以上      | 2年以上 | 2年未満 |
|        |                           | 外 貨 建 金 額                 | 邦貨換算金額        |      |      |                    |           |      |      |
| トルコ    | 千トルコ・リラ<br>9,460          | 千トルコ・リラ<br>9,510          | 千円<br>335,252 | 9.7  | —    | 4.3                | 4.3       | 1.1  |      |
| メキシコ   | 千メキシコ・ペソ<br>54,670        | 千メキシコ・ペソ<br>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<br>5,000        | 千フィリピン・ペソ<br>5,244        | 11,432        | 0.3  | —    | —                  | 0.3       | —    |      |
| コロンビア  | 千コロンビア・ペソ<br>6,465,000    | 千コロンビア・ペソ<br>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<br>40,719,000 | 千インドネシア・ルピア<br>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<br>12,770       | 千ブラジル・レアル<br>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<br>3,190        | 千ルーマニア・レイ<br>3,529        | 89,075        | 2.6  | —    | 0.7                | 1.6       | 0.3  |      |
| ロシア    | 千ロシア・ルーブル<br>120,540      | 千ロシア・ルーブル<br>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<br>12,570    | 千マレーシア・リンギット<br>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<br>48,640      | 千南アフリカ・ランド<br>45,068      | 316,381       | 9.2  | —    | 7.2                | 1.6       | 0.4  |      |
| タイ     | 千タイ・バーツ<br>82,800         | 千タイ・バーツ<br>92,679         | 270,623       | 7.8  | —    | 4.8                | 2.4       | 0.7  |      |
| ペルー    | 千ペルー・ヌエボソル<br>1,960       | 千ペルー・ヌエボソル<br>2,123       | 66,094        | 1.9  | —    | 1.6                | 0.3       | —    |      |
| ポーランド  | 千ポーランド・ズロチ<br>12,290      | 千ポーランド・ズロチ<br>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<br>435,000   | 千ハンガリー・フォリント<br>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<br>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<br>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<br>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          |            |
| コロンビア  |            | 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<br>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          |            |
| インドネシア |            | 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<br>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          |            |
| ブラジル   |            | 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<br>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          |            |
| ルーマニア  |            | 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<br>金 額 | Romania Government Bond         | 国債証券 | % 2.5000 | 千ルーマニア・レイ<br>220    | 千ルーマニア・レイ<br>225    | 千円<br>5,686  | 2019/04/29 |
|                      |            | Romania Government Bond         | 国債証券 | 3.2500   | 200                 | 207                 | 5,225        | 2021/03/22 |
| 通貨小計                 |            | 9銘柄                             |      |          | 3,190               | 3,529               | 89,075       |            |
| ロシア                  | 銘柄数<br>金 額 | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | % 7.5000 | 千ロシア・ルーブル<br>6,800  | 千ロシア・ルーブル<br>6,653  | 千円<br>10,646 | 2018/03/15 |
|                      |            | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.6000   | 7,880               | 7,640               | 12,225       | 2021/04/14 |
|                      |            | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.5000   | 7,130               | 6,912               | 11,060       | 2019/02/27 |
|                      |            | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 8.1500   | 13,060              | 13,141              | 21,026       | 2027/02/03 |
|                      |            | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.6000   | 6,610               | 6,391               | 10,226       | 2022/07/20 |
|                      |            | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 6.8000   | 6,500               | 6,162               | 9,859        | 2019/12/11 |
|                      |            | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.0000   | 8,400               | 7,909               | 12,655       | 2023/01/25 |
|                      |            | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.0500   | 11,660              | 10,789              | 17,262       | 2028/01/19 |
|                      |            | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 6.2000   | 6,600               | 6,313               | 10,102       | 2018/01/31 |
|                      |            | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 6.4000   | 8,100               | 7,563               | 12,101       | 2020/05/27 |
|                      |            | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 6.7000   | 10,000              | 9,506               | 15,209       | 2019/05/15 |
|                      |            | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.0000   | 11,800              | 11,062              | 17,700       | 2023/08/16 |
|                      |            | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.5000   | 5,000               | 4,817               | 7,708        | 2021/08/18 |
|                      |            | Russian Foreign Bond - Eurobond | 国債証券 | 7.8500   | 5,000               | 4,894               | 7,831        | 2018/03/10 |
| 通貨小計                 |            | 15銘柄                            |      |          | 120,540             | 115,912             | 185,460      |            |
| マレーシア                | 銘柄数<br>金 額 | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | % 4.2400 | 千マレーシア・リンギット<br>660 | 千マレーシア・リンギット<br>676 | 千円<br>17,304 | 2018/02/07 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 5.7340   | 350                 | 375                 | 9,598        | 2019/07/30 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.3780   | 780                 | 809                 | 20,693       | 2019/11/29 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.0120   | 540                 | 548                 | 14,025       | 2017/09/15 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.4980   | 620                 | 646                 | 16,542       | 2030/04/15 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.1600   | 560                 | 579                 | 14,819       | 2021/07/15 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.3920   | 490                 | 514                 | 13,167       | 2026/04/15 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.2320   | 330                 | 336                 | 8,598        | 2031/06/30 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.5800   | 510                 | 518                 | 13,245       | 2018/09/28 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.4180   | 440                 | 434                 | 11,109       | 2022/08/15 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.1270   | 280                 | 276                 | 7,067        | 2032/04/15 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.3140   | 560                 | 564                 | 14,446       | 2017/10/31 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.4920   | 540                 | 543                 | 13,906       | 2020/03/31 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.2600   | 460                 | 464                 | 11,879       | 2018/03/01 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.4800   | 470                 | 464                 | 11,877       | 2023/03/15 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.8440   | 220                 | 209                 | 5,361        | 2033/04/15 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.8890   | 470                 | 481                 | 12,309       | 2020/07/31 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.1810   | 510                 | 526                 | 13,460       | 2024/07/15 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.0480   | 650                 | 672                 | 17,185       | 2021/09/30 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.6540   | 560                 | 567                 | 14,505       | 2019/10/31 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.9550   | 660                 | 668                 | 17,095       | 2025/09/15 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.6590   | 590                 | 599                 | 15,320       | 2020/10/15 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.7950   | 590                 | 595                 | 15,220       | 2022/09/30 |
|                      |            | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.7590   | 380                 | 387                 | 9,901        | 2019/03/15 |
| MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券       | 3.8000                          | 350  | 355      | 9,085               | 2023/08/17          |              |            |
| 通貨小計                 |            | 25銘柄                            |      |          | 12,570              | 12,816              | 327,728      |            |
| 南アフリカ                | 銘柄数<br>金 額 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | % 8.2500 | 千南アフリカ・ランド<br>1,930 | 千南アフリカ・ランド<br>1,946 | 千円<br>13,663 | 2017/09/15 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 8.0000   | 2,350               | 2,357               | 16,550       | 2018/12/21 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 7.2500   | 2,940               | 2,872               | 20,162       | 2020/01/15 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 10.5000  | 6,300               | 7,078               | 49,687       | 2026/12/21 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 6.2500   | 3,920               | 2,871               | 20,158       | 2036/03/31 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 6.7500   | 2,760               | 2,606               | 18,294       | 2021/03/31 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 6.5000   | 3,750               | 2,707               | 19,006       | 2041/02/28 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 7.0000   | 4,240               | 3,525               | 24,749       | 2031/02/28 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 7.7500   | 2,280               | 2,203               | 15,467       | 2023/02/28 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 8.7500   | 4,970               | 4,625               | 32,472       | 2048/02/28 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 8.5000   | 3,000               | 2,771               | 19,453       | 2037/01/31 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 8.0000   | 3,400               | 3,121               | 21,912       | 2030/01/31 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 8.7500   | 2,600               | 2,426               | 17,036       | 2044/01/31 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 8.2500   | 2,500               | 2,305               | 16,181       | 2032/03/31 |
|                      |            | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA        | 国債証券 | 8.8750   | 1,700               | 1,650               | 11,584       | 2035/02/28 |
|                      |            | 通貨小計                            |      | 15銘柄     |                     |                     | 48,640       | 45,068     |

| 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<br>4,250       | 千タイ・バーツ<br>4,504       | 千円<br>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<br>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<br>380      | 千ペルー・ヌエボソル<br>384      | 千円<br>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<br>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<br>910      | 千ポーランド・ズロチ<br>1,086    | 千円<br>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<br>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<br>39,300 | 千ハンガリー・フォリント<br>41,638 | 千円<br>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<br>金 額               | 13銘柄  |        | 435,000                | 491,818                | 177,005      |            |
| 合 計   | 銘柄数<br>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<br>千円 | 94.7<br>% |
| 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-1'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。<br>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。<br>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<br>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<br>(配当込み) |            | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 不動産投信<br>指数先<br>物率 | 純資産<br>総額    |
|--------------------|------------|------------|------------|--------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------|
|                    | 税込み<br>分配金 | 期 中<br>騰落率 | (ベンチマーク)   | 期 中<br>騰落率         |            |                    |                    |              |
| 1 期末 (2017年 6月15日) | 円<br>9,906 | 円<br>0     | %<br>△ 0.9 | 3,274.94           | %<br>△ 0.7 | %<br>98.3          | %<br>1.4           | 百万円<br>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<br>(配当込み) |       | 投資信託<br>証 券<br>組入比率 | 不動産投信<br>指数先物<br>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)<br>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

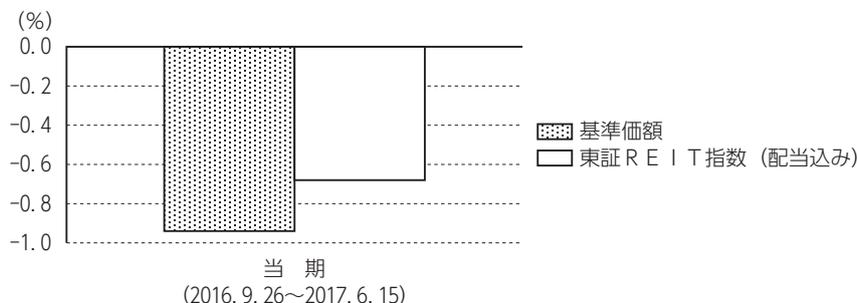
ベンチマーク（東証REIT指数（配当込み））の動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物含む。）については、期を通じて99~100%程度としました。

## 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<br>～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<br>(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<br>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<br>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<br>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<br>J-REIT<br>マザーファンド | 505,190<br>千口 | 1,234,901<br>千円 | 2,254<br>千口 | 5,513<br>千円 |

(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         |              |              |
|--------|------------|--------------|--------------|
|        | 買付額        | 売付額          | 期末保有額        |
| 投資信託証券 | 595<br>百万円 | 2,359<br>百万円 | 4,213<br>百万円 |

(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           |
|--------|--------------|
|        | 買付額          |
| 投資信託証券 | 2,546<br>百万円 |

(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            |
|----------|----------|----------|----------|------------------|
| 1<br>百万円 | —<br>百万円 | 1<br>百万円 | —<br>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<br>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<br>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                 |
|---------------------------|-----------------------|
| <b>(A) 資産</b>             | <b>1,225,040,819円</b> |
| コール・ローン等                  | 3,257,535             |
| ダイワJ-REITマザーファンド<br>(評価額) | 1,221,783,284         |
| <b>(B) 負債</b>             | <b>829,313</b>        |
| 未払解約金                     | 27,428                |
| 未払信託報酬                    | 788,919               |
| その他未払費用                   | 12,966                |
| <b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>  | <b>1,224,211,506</b>  |
| 元本                        | 1,235,784,993         |
| 次期繰越損益金                   | △ 11,573,487          |
| <b>(D) 受益権総口数</b>         | <b>1,235,784,993口</b> |
| <b>1万口当り基準価額 (C / D)</b>  | <b>9,906円</b>         |

\* 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                 |
|------------------------------|---------------------|
| <b>(A) 配当等収益</b>             | <b>△ 869円</b>       |
| 受取利息                         | 24                  |
| 支払利息                         | △ 893               |
| <b>(B) 有価証券売買損益</b>          | <b>△ 8,317,383</b>  |
| 売買益                          | 179,091             |
| 売買損                          | △ 8,496,474         |
| <b>(C) 信託報酬等</b>             | <b>△ 1,549,197</b>  |
| <b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b> | <b>△ 9,867,449</b>  |
| <b>(E) 追加信託差損益金</b>          | <b>△ 1,706,038</b>  |
| (配当等相当額)                     | (△) 589             |
| (売買損益相当額)                    | (△) 1,705,449       |
| <b>(F) 合計 (D + E)</b>        | <b>△ 11,573,487</b> |
| <b>次期繰越損益金 (F)</b>           | <b>△ 11,573,487</b> |
| 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 |
| 三井不動産パーク        | 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           | %           |    |  |
| <b>不動産投信</b>       |              |            |     | <b>オリックス不動産投資</b> | 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。<br>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。<br>③運用の効率化を図るため、不動産投資指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投資指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 |
| 投資信託証券組入制限 | 無制限   |

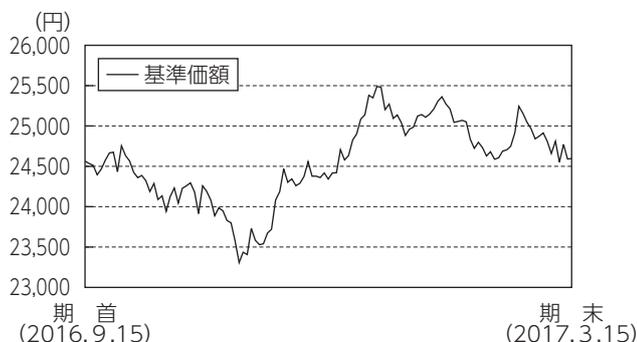
# 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

### ■当期中の基準価額と市況の推移



### ◆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(不動産投資指数先物含む)については、期を通じて99~100%程度としました。

### ◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク(東証REIT指数(配当込み))の騰落率は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。

| 年月日            | 基準価額   |          | 東証REIT指数(配当込み) |      | 不動産投資指数先物 |      |
|----------------|--------|----------|----------------|------|-----------|------|
|                | 騰落率    | (ベンチマーク) | 騰落率            | 組入比率 | 騰落率       | 組入比率 |
| (期首)2016年9月15日 | 円      | %        | 円              | %    | 円         | %    |
| 9月末            | 24,565 | -        | 3,310.77       | -    | 98.9      | 1.1  |
| 10月末           | 24,754 | 0.8      | 3,336.34       | 0.8  | 98.9      | 1.1  |
| 11月末           | 24,258 | △1.2     | 3,269.40       | △1.2 | 98.5      | 1.1  |
| 12月末           | 24,469 | △0.4     | 3,298.65       | △0.4 | 98.5      | 1.1  |
| 2017年1月末       | 25,380 | 3.3      | 3,422.06       | 3.4  | 98.9      | 1.1  |
| 2月末            | 25,273 | 2.9      | 3,407.69       | 2.9  | 98.9      | 1.0  |
| 3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) 不動産投資指数先物比率は買建比率-売建比率です。

### 《運用経過》

#### ◆基準価額等の推移について

##### 【基準価額・騰落率】

期首：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。

### ■1万口当りの費用の明細

| 項目              | 当 期 |
|-----------------|-----|
| 売買委託手数料<br>(先物) | 0円  |
| (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     | 千円         | 千口            | 千円               |
|    | 232.87 | 47,039,992 | 13.554<br>(-) | 2,522,661<br>(-) |

(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          | 百万円   | 百万円   | 百万円   | 百万円   |
| 不動産投資指数先物取引 | 7,836 | 6,624 | -     | -     |

(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。

■主要な売買銘柄  
投資信託証券

(2016年9月16日から2017年3月15日まで)

| 銘柄              | 当 期    |           |         | 期 末            |       |         |
|-----------------|--------|-----------|---------|----------------|-------|---------|
|                 | 買 付    | 金 額       | 平均単価    | 売 付            | 金 額   | 平均単価    |
|                 | 口数     | 千円        | 円       | 口数             | 千円    | 円       |
| ジャパンリアルエステイト    | 4,988  | 3,130,254 | 627,557 | 大和証券オフィス投資法人   | 1,427 | 841,272 |
| 日本ビルファンド        | 4,684  | 2,987,612 | 637,833 | 森トラスト総合リート     | 1.51  | 274,926 |
| 日本リテールファンド      | 12,024 | 2,813,134 | 233,959 | いちごオフィスリート投資法人 | 2,631 | 194,936 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 13,768 | 2,416,870 | 175,542 | 日本プロロジスリート     | 0.618 | 148,362 |
| オリックス不動産投資      | 13,363 | 2,391,168 | 178,939 | G L P 投資法人     | 0.925 | 117,447 |
| 野村不動産マスターF      | 13,877 | 2,386,754 | 171,993 | イオンリート投資       | 0.819 | 103,232 |
| 日本プライムリアルティ     | 4,047  | 1,852,178 | 457,667 | 森ヒルズリート        | 0.568 | 86,325  |
| 三井不ロジパーク        | 5,525  | 1,794,723 | 324,836 | インヴィンシブル投資法人   | 1.364 | 65,175  |
| A P I 投資法人      | 3,245  | 1,685,731 | 519,485 | ヒューリックリート投資法   | 0.334 | 61,258  |
| アドバンス・レジデンス     | 5,521  | 1,605,459 | 290,791 | スターアジア不動産投     | 0.592 | 57,307  |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| ファンド名                 | 当 期 末     |             |   |         |
|-----------------------|-----------|-------------|---|---------|
|                       | 口数        | 評 価 額       | 比 | 率       |
| 不動産投資                 | 千口        | 千円          |   | %       |
| 日本アコモデーションファンド投資法人    | 11,684    | 5,695,950   |   | 2.0     |
| MCUBS MidCity投資法人     | 7,109     | 2,356,633   |   | 0.8     |
| 森ヒルズリート               | 40.2      | 6,030,000   |   | 2.1     |
| 産業ファンド                | 9,551     | 4,880,561   |   | 1.7     |
| アドバンス・レジデンス           | 32,555    | 9,864,165   |   | 3.5     |
| ケネディクスレジデンシャル         | 8,217     | 2,514,402   |   | 0.9     |
| A P I 投資法人            | 15,658    | 8,361,372   |   | 2.9     |
| G L P 投資法人            | 65,516    | 8,451,564   |   | 3.0     |
| コンフォリア・レジデンシャル        | 13,212    | 3,271,291   |   | 1.1     |
| 日本プロロジスリート            | 43,776    | 10,545,638  |   | 3.7     |
| 星野リゾート・リート            | 4.03      | 2,317,250   |   | 0.8     |
| S I A 不動産投資           | 4,238     | 793,777     |   | 0.3     |
| イオンリート投資              | 35,343    | 4,485,026   |   | 1.6     |
| ヒューリックリート投資法          | 23,997    | 4,369,853   |   | 1.5     |
| 日本リート投資法人             | 9,447     | 2,691,450   |   | 0.9     |
| インベスコ・オフィス・Jリート       | 19,666    | 1,964,633   |   | 0.7     |
| 日本ヘルスケア投資法            | 1,757     | 304,312     |   | 0.1     |
| 積水ハウス・リート投資           | 21,043    | 3,110,155   |   | 1.1     |
| トーセイ・リート投資法人          | 4,417     | 472,619     |   | 0.2     |
| ケネディクス商業リート           | 10,413    | 2,678,223   |   | 0.9     |
| ヘルスケア&メディカル投資         | 4,465     | 437,570     |   | 0.2     |
| サムディ・レジデンシャル          | 6,499     | 542,666     |   | 0.2     |
| ジャパン・シニアリビング          | 1,995     | 276,507     |   | 0.1     |
| 野村不動産マスターF            | 100,873   | 17,007,187  |   | 6.0     |
| いちごホテルリート投資           | 5,915     | 694,421     |   | 0.2     |
| ラサールロジサポート投資          | 26,526    | 2,782,577   |   | 1.0     |
| スターアジア不動産投            | 7,321     | 735,028     |   | 0.3     |
| マリモ地方創生リート            | 2,089     | 188,845     |   | 0.1     |
| 三井不ロジパーク              | 5,521     | 1,769,480   |   | 0.6     |
| 大江戸温泉リート              | 4,343     | 389,132     |   | 0.1     |
| さくら総合リート              | 8,208     | 650,073     |   | 0.2     |
| 投資法人みらい               | 4,344     | 727,620     |   | 0.3     |
| 日本ビルファンド              | 34,049    | 20,837,988  |   | 7.3     |
| ジャパンリアルエステイト          | 32,272    | 19,685,920  |   | 6.9     |
| 日本リテールファンド            | 65,207    | 14,775,906  |   | 5.2     |
| オリックス不動産投資            | 65,868    | 11,513,726  |   | 4.0     |
| 日本プライムリアルティ           | 22,201    | 9,690,736   |   | 3.4     |
| アプレシア投資法人             | 31,759    | 3,969,875   |   | 1.4     |
| 東急リアル・エステート           | 23,574    | 3,234,352   |   | 1.1     |
| グローバル・ワン不動産投資法人       | 4,777     | 1,867,807   |   | 0.7     |
| ユナイテッド・アーバン投資法人       | 75,303    | 13,012,358  |   | 4.6     |
| 森トラスト総合リート            | 28,792    | 5,104,821   |   | 1.8     |
| インヴィンシブル投資法人          | 84,185    | 3,994,578   |   | 1.4     |
| フロントティア不動産投資          | 11,961    | 5,920,695   |   | 2.1     |
| 平和不動産リート              | 23,304    | 1,973,848   |   | 0.7     |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人     | 21,691    | 5,097,385   |   | 1.8     |
| 福岡リート投資法人             | 17,584    | 3,182,704   |   | 1.1     |
| ケネディクス・オフィス投資法人       | 9,98      | 6,506,960   |   | 2.3     |
| 積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 | 26,658    | 3,270,936   |   | 1.1     |
| いちごオフィスリート投資法人        | 32,54     | 2,355,896   |   | 0.8     |
| 大和証券オフィス投資法人          | 10        | 5,800,000   |   | 2.0     |
| 阪急リート投資法人             | 14,409    | 2,168,554   |   | 0.8     |
| スタートアップリート投資法人        | 5,896     | 888,527     |   | 0.3     |
| 大和ハウスリート投資法人          | 35,201    | 9,990,043   |   | 3.5     |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人      | 92,725    | 7,260,367   |   | 2.5     |
| 日本賃貸住宅投資法人            | 39,549    | 3,211,378   |   | 1.1     |
| ジャパンエクセレント投資法人        | 31,486    | 4,398,594   |   | 1.5     |
| 合 計                   | 1,400,899 | 281,073,951 |   | <98.6%> |

※森ヒルズリート、産業ファンド、アドバンス・レジデンス、A P I 投資法人、G L P 投資法人、コンフォリア・レジデンシャル、日本プロロジスリート、S I A 不動産投資、イオンリート投資、ヒューリックリート投資法人、日本ヘルスケア投資法人、積水ハウス・リート投資、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート、サムディ・レジデンシャル、スターアジア不動産投資、三井不ロジパーク、さくら総合リート、日本ビルファンド、日本リテールファンド、オリックス不動産投資、日本プライムリアルティ、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、スタートアップリート投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人につきましては、各ファンドで開示されている最近の有価証券報告書または有価証券届出書において、当社の利害関係人等（投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される法人等をいいます。）である大和証券、大和リアル・エステート・アセット・マネジメント、ミカサ・アセット・マネジメントが当該ファンドの運用会社または一般事務受託会社となっています。  
(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。  
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

| 銘柄         | 当 期 末        |          |
|------------|--------------|----------|
|            | 買 建 額        | 売 建 額    |
| 東証 R E I T | 百万円<br>3,836 | 百万円<br>- |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年3月15日現在

| 項 目          | 当 期 末             |           |
|--------------|-------------------|-----------|
|              | 評 価 額             | 比 率       |
| 投資信託証券       | 千円<br>281,073,951 | %<br>98.1 |
| コール・ローン等、その他 | 5,556,684         | 1.9       |
| 投資信託財産総額     | 286,630,636       | 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3月15日現在

| 項 目            | 当 期 末            |
|----------------|------------------|
| (A) 資産         | 287,016,411,095円 |
| コール・ローン等       | 2,352,579,062    |
| 投資信託証券(評価額)    | 281,073,951,150  |
| 未収配当金          | 3,076,465,683    |
| 差入委託証拠金        | 513,415,200      |
| (B) 負債         | 1,976,435,344    |
| 未払金            | 617,437,344      |
| 未払解約金          | 973,223,000      |
| 差入委託証拠金代用有価証券  | 385,775,000      |
| (C) 純資産総額(A-B) | 285,039,975,751  |
| 元本             | 115,884,390,053  |
| 次期繰越損益金        | 169,155,585,698  |
| (D) 受益権総口数     | 115,884,390,053口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 24,597円          |

\*期首における元本額は99,360,552,313円、当期中における追加設定元本額は18,137,239,879円、同解約元本額は1,613,402,139円です。  
\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワJ-R E I T オープン10,242,758,788円、ダイワJ-R E I T オープン（毎月分配型）99,982,332,225円、ダイワJ-R E I T オープン（年1回決算型）421,422,495円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 22,838円、i F r e e J - R E I T インデックス50,392,226円、i F r e e 8資産バランス102,282,703円、D C・ダイワJ-R E I T オープン3,249,798,817円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 3,698,470円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 5,228,734円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 982,540円、ダイワ・ノーロード J-R E I T ファンド53,093,627円、ダイワファンドラップ J-R E I T インデックス373,923,719円、ダイワJ-R E I T インデックス（ダイワSMA専用）404,360円、ダイワファンドラップオンライン J-R E I T インデックス31,937,282円、ダイワ・インデックスセレクト J-R E I T 1,366,111,229円です。  
\*当期末の計算口数当りの純資産額は24,597円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月16日 至2017年3月15日

| 項 目              | 当 期             |
|------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益        | 4,915,706,844円  |
| 受取配当金            | 4,914,748,974   |
| 受取利息             | 8               |
| その他収益金           | 1,574,967       |
| 支払利息             | △ 617,105       |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 4,757,121,932 |
| 売買益              | 3,310,003,513   |
| 売買損              | △ 8,067,125,445 |
| (C) 先物取引等損益      | 3,061,312       |
| 取引益              | 86,861,326      |
| 取引損              | △ 83,800,014    |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 161,646,224     |
| (E) 前期繰越損益金      | 144,714,583,214 |
| (F) 解約差損益金       | △ 2,322,076,461 |
| (G) 追加信託差損益金     | 26,601,432,721  |
| (H) 合計(D+E+F+G)  | 169,155,585,698 |
| 次期繰越損益金(H)       | 169,155,585,698 |

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|              |  |  |
|--------------|--|--|
| 商品分類         | 追加型投信／海外／不動産投信（リート）  |  |
| 信託期間         | 無期限  |  |
| 運用方針         | 海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。   |  |
| 主投資対象        | ベビーファンド  | ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券   |
|              | ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド  | 海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）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 &amp; 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<br>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<br>(除く日本) (現地通貨ベース)<br>(参考指数) |            | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額    |
|-----------------|------------|-----------|------------|--|------------|--------------------|--------------|
|                 | 税込み<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | 期中<br>騰落率  | 期中<br>騰落率                                    | 期中<br>騰落率  |                    |              |
| 1期末(2017年6月15日) | 円<br>9,844 | 円<br>0    | %<br>△ 1.6 | 9,995  | %<br>△ 0.1 | %<br>98.2          | 百万円<br>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。

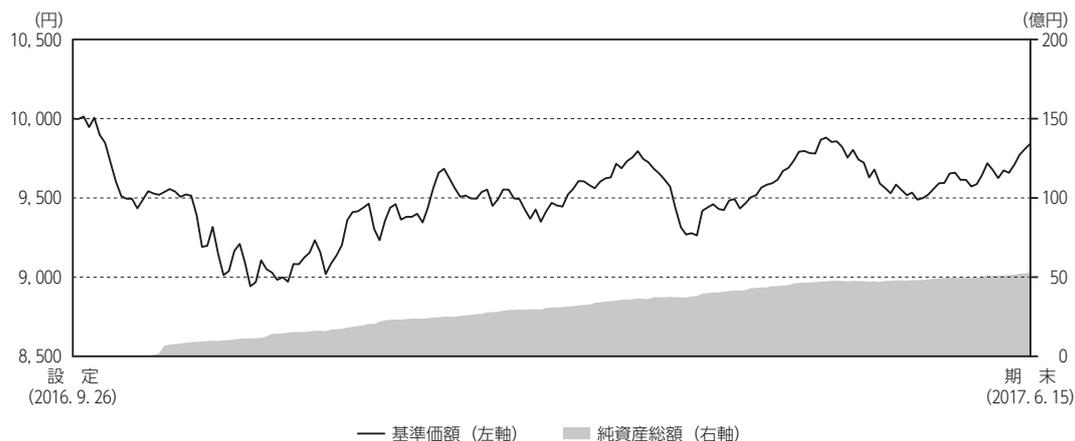
(注2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(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<br>(除く日本) (現地通貨ベース) |         | 投資信託<br>証 券<br>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

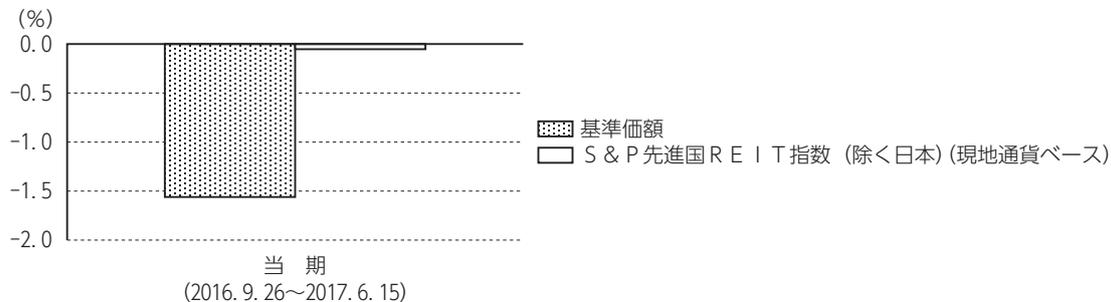
ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウェイトで組成し、ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））との連動性を維持するような運用を行ないました。

## 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<br>～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<br>(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<br>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<br>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/期中の平均受益権総口数<br>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/期中の平均受益権総口数   |
| (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。

### ■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・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。

### ■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                  |
|-----------------------------------|------------------------|
| <b>(A) 資産</b>                     | <b>10,367,937,335円</b> |
| 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>(B) 負債</b>                     | <b>5,082,348,949</b>   |
| 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                 |
| <b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>          | <b>5,285,588,386</b>   |
| 元本                                | 5,369,088,014          |
| 次期繰越損益金                           | △ 83,499,628           |
| <b>(D) 受益権総口数</b>                 | <b>5,369,088,014口</b>  |
| 1万口当り基準価額 (C/D)                   | <b>9,844円</b>          |

\*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                  |
|------------------------------|----------------------|
| <b>(A) 配当等収益</b>             | <b>△ 1,230円</b>      |
| 受取利息                         | 1                    |
| その他収益金                       | 1,970                |
| 支払利息                         | △ 3,201              |
| <b>(B) 有価証券売買損益</b>          | <b>218,416,780</b>   |
| 売買益                          | 461,103,281          |
| 売買損                          | △ 242,686,501        |
| <b>(C) 信託報酬等</b>             | <b>△ 9,133,290</b>   |
| <b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b> | <b>209,282,260</b>   |
| <b>(E) 追加信託差損益金</b>          | <b>△ 292,781,888</b> |
| (配当等相当額)                     | (△ 430)              |
| (売買損益相当額)                    | (△ 292,781,458)      |
| <b>(F) 合計 (D + E)</b>        | <b>△ 83,499,628</b>  |
| <b>次期繰越損益金 (F)</b>           | <b>△ 83,499,628</b>  |
| 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<br>銘柄数 < 比率 > | 112,256<br>29 銘柄  | 2,204<br>182,731  | <1.8%> |
| <b>(オーストラリア)</b>             | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 2,339.22<br>30 銘柄 | 10,010<br>833,664 | <8.1%> |
| <b>(香港)</b>                  | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 806<br>8 銘柄       | 14,914<br>209,840 | <2.0%> |
| <b>(シンガポール)</b>              | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 2,802.47<br>30銘柄 | 3,840<br>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<br>銘柄数 < 比率 > | 415.38<br>8銘柄    | 578<br>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<br>銘柄数 < 比率 > | 1,128.07<br>26銘柄 | 4,009<br>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<br>銘柄数 < 比率 > | 9.34<br>1銘柄      | 122<br>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<br>銘柄数 < 比率 > | 138.12<br>3銘柄    | 197<br>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<br>銘柄数 < 比率 > | 20.52<br>4銘柄     | 391<br>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<br>0.5            | 千ユーロ<br>40          | 千円<br>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<br>銘柄数 < 比率 > | 8,558<br>10 銘柄      | 604<br>74,383    | <0.7%>  |
| <b>ユーロ (フランス)</b>             | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 41.48<br>7 銘柄       | 3,785<br>466,006 | <4.5%>  |
| <b>ユーロ (ドイツ)</b>              | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 14.29<br>2 銘柄       | 160<br>19,810    | <0.2%>  |
| <b>ユーロ (スペイン)</b>             | 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<br>銘柄数 < 比率 > | 59.48<br>4 銘柄       | 707<br>87,053    | <0.8%>  |
| <b>ユーロ (イタリア)</b>             | 千口                   | 千ユーロ                | 千円               |         |
| BENI STABILI SPA              | 82.03                | 54                  | 6,766            | 0.1     |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZI | 30.4                 | 25                  | 3,102            | 0.0     |
| 国 小 計                         | □ 数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 112.43<br>2 銘柄      | 80<br>9,868      | <0.1%>  |
| ユ ー ロ 通 貨 計                   | □ 数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 394.878<br>32 銘柄    | 5,927<br>729,682 | <7.1%>  |
| 合 計                           | □ 数、金額<br>銘柄数 < 比率 > | 9,801.395<br>322 銘柄 | —<br>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。<br>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。<br>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   |

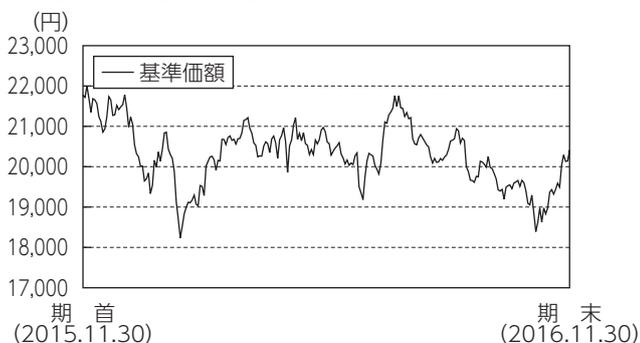
## 大和投資信託

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) | 円                            | 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ないます。リートの組入比率は、期を通じて原則として97%以上で運用を行ないます。また、保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

◆ポートフォリオについて

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

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（「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なわず、S & P先進国REIT指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■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 | 金    | 額       | 売                                   | 付 | 金   | 額     |
| 銘                                | 柄 | 口    | 平均単価    | 銘                                   | 柄 | 口   | 平均単価  |
|                                  |   | 千口   | 千円      |                                     |   | 千口  | 千円    |
| SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)  |   | 7.3  | 153,342 | PUBLIC STORAGE (アメリカ)               |   | 0.1 | 2,628 |
| PUBLIC STORAGE (アメリカ)            |   | 3.5  | 83,905  | SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)     |   | 0.1 | 2,325 |
| PROLOGIS INC (アメリカ)              |   | 12.1 | 64,679  | MACERICH CO/THE (アメリカ)              |   | 0.2 | 1,789 |
| WELLTOWER INC (アメリカ)             |   | 8.4  | 62,173  | WELLTOWER INC (アメリカ)                |   | 0.2 | 1,589 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ) |   | 3.2  | 59,234  | BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)        |   | 0.1 | 1,505 |
| VENTAS INC (アメリカ)                |   | 8.4  | 58,836  | SL GREEN REALTY CORP (アメリカ)         |   | 0.1 | 1,420 |
| UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)        |   | 2.2  | 58,267  | MILESTONE APARTMENTS REAL ES (カナダ)  |   | 0.9 | 1,299 |
| EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)        |   | 8.4  | 58,014  | CAMPUS CREST COMMUNITIES INC (アメリカ) |   | 1.3 | 1,030 |
| BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)     |   | 3.6  | 49,084  | INNVEST REAL ESTATE INVESTME (カナダ)  |   | 1.7 | 964   |
| SCENTRE GROUP (オーストラリア)          |   | 11.9 | 42,501  | EXTRA SPACE STORAGE INC (アメリカ)      |   | 0.1 | 959   |

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

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) ( )内は株式分割、割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。  
(注3) 金額の単位未満は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 | アメリカ             | 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                   |
|     |                  | 523.2<br>(△ 4.402)        | 18,274<br>(△ 229)            | 4.6<br>( - )        | 177<br>( - )               |
|     | カナダ              | 千口<br>32.9<br>( - )       | 千カナダ・ドル<br>610<br>(△ 0)      | 千口<br>2.8<br>( - )  | 千カナダ・ドル<br>30<br>( - )     |
|     | オーストラリア          | 千口<br>626.088<br>( 0.6)   | 千オーストラリア・ドル<br>2,556<br>( 1) | 千口<br>6<br>( - )    | 千オーストラリア・ドル<br>21<br>( - ) |
|     | 香港               | 千口<br>216<br>( - )        | 千香港ドル<br>3,453<br>( - )      | 千口<br>10<br>( - )   | 千香港ドル<br>22<br>( - )       |
|     | シンガポール           | 千口<br>798<br>( 14.201)    | 千シンガポール・ドル<br>1,032<br>( 3)  | 千口<br>22.3<br>( - ) | 千シンガポール・ドル<br>18<br>( - )  |
|     | ニュージーランド         | 千口<br>117.792<br>( 2.25)  | 千ニュージーランド・ドル<br>166<br>(△ 0) | 千口<br>-<br>( - )    | 千ニュージーランド・ドル<br>-<br>( - ) |
|     | イギリス             | 千口<br>335.911<br>( 3.439) | 千イギリス・ポンド<br>1,022<br>( 4)   | 千口<br>0.2<br>( - )  | 千イギリス・ポンド<br>2<br>( - )    |
|     | イスラエル            | 千口<br>2.69<br>( - )       | 千イスラエル・シケル<br>31<br>( - )    | 千口<br>-<br>( - )    | 千イスラエル・シケル<br>-<br>( - )   |
|     | ユーロ<br>(アイルランド)  | 千口<br>37.9<br>( - )       | 千ユーロ<br>49<br>( - )          | 千口<br>-<br>( - )    | 千ユーロ<br>-<br>( - )         |
|     | ユーロ<br>(オランダ)    | 千口<br>5.196<br>( - )      | 千ユーロ<br>104<br>( - )         | 千口<br>0.05<br>( - ) | 千ユーロ<br>1<br>( - )         |
|     | ユーロ<br>(ベルギー)    | 千口<br>2.644<br>( - )      | 千ユーロ<br>173<br>(△ 0)         | 千口<br>-<br>( - )    | 千ユーロ<br>-<br>( - )         |
|     | ユーロ<br>(フランス)    | 千口<br>12.8<br>(△ 0.2)     | 千ユーロ<br>1,048<br>(△ 6)       | 千口<br>0.4<br>( - )  | 千ユーロ<br>7<br>( - )         |
|     | ユーロ<br>(ドイツ)     | 千口<br>4.266<br>( - )      | 千ユーロ<br>45<br>(△ 1)          | 千口<br>-<br>( - )    | 千ユーロ<br>-<br>( - )         |
|     | ユーロ<br>(スペイン)    | 千口<br>22<br>( 0.675)      | 千ユーロ<br>220<br>( 2)          | 千口<br>-<br>( - )    | 千ユーロ<br>-<br>( - )         |
|     | ユーロ<br>(イタリア)    | 千口<br>27.25<br>( - )      | 千ユーロ<br>15<br>(△ 0)          | 千口<br>-<br>( - )    | 千ユーロ<br>-<br>( - )         |
|     | ユーロ<br>(ユーロ 通貨計) | 千口<br>112.056<br>( 0.475) | 千ユーロ<br>1,657<br>(△ 6)       | 千口<br>0.45<br>( - ) | 千ユーロ<br>9<br>( - )         |

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 買付( )内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。  
(注3) 売付( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。  
(注4) 金額の単位未満は四捨五入してあります。

■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                              | □ 数    | 当 期      |         | 比 率 |
|------------------------------------|--------|----------|---------|-----|
|                                    |        | 評 価 額    |         |     |
|                                    |        | 外貨建金額    | 邦貨換算金額  |     |
| <b>不動産ファンド</b>                     |        |          |         |     |
| (シンガポール)                           | 千口     | 千アメリカ・ドル | 千円      | %   |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV (アメリカ) | 24.9   | 20       | 2,323   | 0.0 |
| 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 COMMUN-A       | 1      | 13       | 1,571   | 0.0 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A        | 5.4    | 109      | 12,287  | 0.2 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN       | 2.7    | 60       | 6,814   | 0.1 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC        | 5.3    | 112      | 12,631  | 0.2 |
| STAG INDUSTRIAL INC                | 3.4    | 81       | 9,116   | 0.2 |
| VENTAS INC                         | 15,779 | 963      | 108,330 | 2.1 |
| CARETRUST REIT INC                 | 2,603  | 37       | 4,228   | 0.1 |
| NEW YORK REIT INC                  | 7.2    | 70       | 7,924   | 0.2 |
| GEO GROUP INC/THE                  | 3.3    | 109      | 12,338  | 0.2 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC         | 11.5   | 288      | 32,411  | 0.6 |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME       | 3.2    | 60       | 6,856   | 0.1 |

| ファンド名                        | □ 数    | 当 期   |          | 比 率 |   |
|------------------------------|--------|-------|----------|-----|---|
|                              |        | 評 価 額 |          |     |   |
|                              |        | 外貨建金額 | 邦貨換算金額   |     |   |
|                              |        | 千口    | 千アメリカ・ドル | 千円  | % |
| 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     | 0.9    | 102   | 11,476   | 0.2 |   |
| REGENCY CENTERS CORP         | 4.6    | 307   | 34,596   | 0.7 |   |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES  | 3.5    | 60    | 6,795    | 0.1 |   |
| ISTAR INC                    | 3.2    | 40    | 4,532    | 0.1 |   |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 4.2    | 147   | 16,558   | 0.3 |   |
| SL GREEN REALTY CORP         | 4.5    | 477   | 53,639   | 1.0 |   |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST    | 10.6   | 193   | 21,795   | 0.4 |   |
| TAUBMAN CENTERS INC          | 2.7    | 199   | 22,391   | 0.4 |   |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A     | 1.2    | 27    | 3,129    | 0.1 |   |
| UDR INC                      | 11.9   | 406   | 45,739   | 0.9 |   |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 0.6    | 36    | 4,069    | 0.1 |   |
| WP CAREY INC                 | 4.7    | 279   | 31,406   | 0.6 |   |
| WASHINGTON REIT              | 3.3    | 103   | 11,608   | 0.2 |   |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS  | 5.1    | 182   | 20,468   | 0.4 |   |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST    | 3.1    | 21    | 2,401    | 0.0 |   |
| AGREE REALTY CORP            | 1      | 45    | 5,111    | 0.1 |   |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 8.65   | 256   | 28,793   | 0.6 |   |
| CUBESMART                    | 7.8    | 193   | 21,746   | 0.4 |   |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 9,426  | 136   | 15,354   | 0.3 |   |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 7.2    | 673   | 75,681   | 1.4 |   |
| CEDAR REALTY TRUST INC       | 2.9    | 19    | 2,148    | 0.0 |   |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 5.6    | 396   | 44,603   | 0.9 |   |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST   | 2.2    | 21    | 2,431    | 0.0 |   |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST     | 1,775  | 35    | 4,000    | 0.1 |   |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST  | 4.7    | 30    | 3,418    | 0.1 |   |
| KITE REALTY GROUP TRUST      | 3.75   | 91    | 10,320   | 0.2 |   |
| MONMOUTH REAL ESTATE INV COR | 3      | 43    | 4,920    | 0.1 |   |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC   | 0.5    | 12    | 1,386    | 0.0 |   |

| 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                  | %       |
| 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<br>銘柄数<比率> | 954,218<br>159銘柄 | 33,730<br>3,791,999 | <72.5%> |
| (カナダ)                        | 千口               | 千カナダ・ドル          | 千円                  | %       |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 3.2              | 37               | 3,146               | 0.1     |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV | 2.6              | 23               | 1,986               | 0.0     |
| SLATE RETAIL REIT - U        | 0.5              | 7                | 597                 | 0.0     |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 1.5              | 18               | 1,518               | 0.0     |
| AGELLAN COMMERCIAL REAL 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<br>銘柄数<比率> | 60,656<br>30銘柄   | 1,140<br>95,421     | <1.8%>  |
| (オーストラリア)                    | 千口               | 千オーストラリア・ドル      | 千円                  | %       |
| FOLKESTONE EDUCATION TRUST   | 9                | 21               | 1,802               | 0.0     |
| CROMWELL PROPERTY GROUP      | 56.5             | 51               | 4,373               | 0.1     |
| GENERATION HEALTHCARE REIT   | 5.5              | 9                | 793                 | 0.0     |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 31               | 65               | 5,503               | 0.1     |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 8.5              | 25               | 2,167               | 0.0     |
| NATIONAL STORAGE REIT        | 21               | 31               | 2,676               | 0.1     |
| INDUSTRIA REIT               | 6.5              | 13               | 1,115               | 0.0     |
| GDI PROPERTY GROUP           | 21               | 20               | 1,722               | 0.0     |
| 360 CAPITAL OFFICE FUND      | 2.5              | 5                | 458                 | 0.0     |
| 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<br>銘柄数<比率> | 1,224.5<br>29銘柄  | 4,902<br>412,455    | <7.9%>  |

| 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               | 千香港ドル            | 千円               | %      |
| (香港)                          |                  |                  |                  |        |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN  | 43               | 184              | 2,668            | 0.1    |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST   | 44               | 202              | 2,934            | 0.1    |
| FORTUNE REIT                  | 59               | 525              | 7,622            | 0.1    |
| PROSPERITY REIT               | 48               | 149              | 2,164            | 0.0    |
| LINK REIT                     | 100              | 5,290            | 76,705           | 1.5    |
| SPRING REAL ESTATE INVESTMEN  | 34               | 108              | 1,577            | 0.0    |
| REGAL REAL ESTATE INVESTMENT  | 29               | 59               | 862              | 0.0    |
| CHAMPION REIT                 | 93               | 409              | 5,933            | 0.1    |
| 香港ドル通貨計                       | □数、金額<br>銘柄数<比率> | 450<br>8銘柄       | 6,928<br>100,468 | <1.9%> |
| (シンガポール)                      | 千口               | 千シンガポール・ドル       | 千円               | %      |
| KEPPEL DC REIT                | 35,028           | 42               | 3,333            | 0.1    |
| FIRST REAL ESTATE INVNT 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    |
| OUÉ HOSPITALITY TRUST         | 46.673           | 29               | 2,358            | 0.0    |
| OUÉ COMMERCIAL REAL ESTATE I  | 17.45            | 11               | 930              | 0.0    |
| シンガポール・ドル通貨計                  | □数、金額<br>銘柄数<比率> | 1,503.37<br>30銘柄 | 1,864<br>147,257 | <2.8%> |
| (ニュージーランド)                    | 千口               | 千ニュージーランド・ドル     | 千円               | %      |
| STRIDE PROPERTY GROUP         | 15               | 28               | 2,251            | 0.0    |
| INVESTORE PROPERTY LTD        | 7.75             | 11               | 889              | 0.0    |
| ARGOSY PROPERTY LTD           | 33               | 34               | 2,793            | 0.1    |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD       | 55.5             | 79               | 6,413            | 0.1    |
| PROPERTY FOR INDUSTRY LTD     | 18.5             | 28               | 2,301            | 0.0    |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR  | 14               | 28               | 2,291            | 0.0    |
| GOODMAN PROPERTY TRUST        | 43.5             | 54               | 4,346            | 0.1    |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL  | 44.5             | 53               | 4,285            | 0.1    |
| ニュージーランド・ドル通貨計                | □数、金額<br>銘柄数<比率> | 231.75<br>8銘柄    | 318<br>25,572    | <0.5%> |
| (イギリス)                        | 千口               | 千イギリス・ポンド        | 千円               | %      |
| ASSURA PLC                    | 70.7             | 41               | 5,834            | 0.1    |
| MUCKLOW (A & J) GROUP PLC     | 2.55             | 11               | 1,665            | 0.0    |
| CAPITAL & REGIONAL PLC        | 20.65            | 11               | 1,588            | 0.0    |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC  | 20.6             | 22               | 3,182            | 0.1    |
| REGIONAL REIT LTD             | 6.65             | 7                | 1,018            | 0.0    |
| 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    |
| SEGRO PLC                     | 36.6             | 153              | 21,519           | 0.4    |
| HAMMERSON PLC                 | 34.65            | 190              | 26,768           | 0.5    |
| BRITISH LAND CO PLC           | 45.2             | 271              | 38,092           | 0.7    |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC    | 15.2             | 92               | 12,927           | 0.2    |
| INTU PROPERTIES PLC           | 39.8             | 108              | 15,183           | 0.3    |
| DERWENT LONDON PLC            | 4.9              | 117              | 16,497           | 0.3    |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES     | 25.85            | 28               | 4,021            | 0.1    |
| WORKSPACE GROUP PLC           | 5.1              | 35               | 4,964            | 0.1    |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC        | 9.15             | 31               | 4,433            | 0.1    |
| SHAFTESBURY PLC               | 12.3             | 112              | 15,799           | 0.3    |
| MCKAY SECURITIES PLC-ORD      | 3.3              | 5                | 838              | 0.0    |
| BIG YELLOW GROUP PLC          | 6.4              | 42               | 6,013            | 0.1    |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC     | 27.2             | 39               | 5,570            | 0.1    |

| ファンド名  | 当 期 末            |                    |           | 比 率      |
|--|------------------|--------------------|-----------|----------|
|  | 口 数              | 評 価 額              | 比 率       |          |
| SCRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRITAX BIG BOX REIT PLC   | 千口               | 千円                 | 千円        | %        |
|  | 22.45            | 13                 | 1,836     | 0.0      |
|  | 47.85            | 63                 | 8,851     | 0.2      |
| イギリス・ポンド通貨計  | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 589.65<br>1,834    | 257,738   | < 4.9%>  |
| (イスラエル) REIT 1 LTD   | 千口               | 千円                 | 千円        | %        |
|  | 5.79             | 65                 | 1,918     | 0.0      |
| イスラエル・シケル通貨計   | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 5.79<br>1銘柄        | 1,918     | < 0.0%>  |
| ユーロ (アイルランド) IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES GREEN REIT PLC HIBERNIA REIT PLC   | 千口               | 千ユーロ               | 千円        | %        |
|  | 15.15            | 17                 | 2,103     | 0.0      |
|  | 29.5             | 36                 | 4,413     | 0.1      |
|  | 30.3             | 35                 | 4,297     | 0.1      |
| 国 小 計  | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 74.95<br>90        | 10,815    | < 0.2%>  |
| ユーロ (オランダ) WERELDHAVE NV EUROCOMMERCIAL PROPRIET-CV NSI NV VASTNED RETAIL NV   | 千口               | 千ユーロ               | 千円        | %        |
|  | 1.75             | 69                 | 8,372     | 0.2      |
|  | 2.1              | 72                 | 8,672     | 0.2      |
|  | 5.75             | 20                 | 2,415     | 0.0      |
|  | 0.8              | 27                 | 3,323     | 0.1      |
| 国 小 計  | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 10.4<br>4銘柄        | 22,784    | < 0.4%>  |
| ユーロ (ベルギー) AEDIFICA COFINIMMO BEFIMMO INTEREST OFFICES&WAREHOUSES RETAIL ESTATES WAREHOUSES DE PAUW SCA WERELDHAVE BELGIUM NV XIOR STUDENT HOUSING NV MONTEA | 千口               | 千ユーロ               | 千円        | %        |
|  | 0.6              | 41                 | 4,962     | 0.1      |
|  | 0.9              | 94                 | 11,284    | 0.2      |
|  | 1                | 52                 | 6,256     | 0.1      |
|  | 0.55             | 12                 | 1,520     | 0.0      |
|  | 0.25             | 18                 | 2,210     | 0.0      |
|  | 0.7              | 56                 | 6,731     | 0.1      |
|  | 0.1              | 10                 | 1,304     | 0.0      |
|  | 0.15             | 5                  | 630       | 0.0      |
|  | 0.25             | 10                 | 1,287     | 0.0      |
| 国 小 計  | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 4.5<br>9銘柄         | 36,189    | < 0.7%>  |
| ユーロ (フランス) UNIBAIL-RODAMCO SE ICADE ALTAREA GECINA SA KLEPIERRE FONCIERE DES REGIONS MERCIALYS   | 千口               | 千ユーロ               | 千円        | %        |
|  | 4.4              | 927                | 111,076   | 2.1      |
|  | 2                | 129                | 15,508    | 0.3      |
|  | 0.1              | 17                 | 2,106     | 0.0      |
|  | 1.8              | 221                | 26,512    | 0.5      |
|  | 9.25             | 326                | 39,140    | 0.7      |
|  | 2.2              | 162                | 19,500    | 0.4      |
|  | 2.4              | 43                 | 5,257     | 0.1      |
| 国 小 計  | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 22.15<br>7銘柄       | 219,102   | < 4.2%>  |
| ユーロ (ドイツ) ALSTRIA OFFICE REIT-AG HAMBORNER REIT AG   | 千口               | 千ユーロ               | 千円        | %        |
|  | 4.45             | 51                 | 6,221     | 0.1      |
|  | 3.45             | 29                 | 3,557     | 0.1      |
| 国 小 計  | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 7.9<br>2銘柄         | 9,778     | < 0.2%>  |
| ユーロ (スペイン) LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA                                 | 千口               | 千ユーロ               | 千円        | %        |
|  | 4                | 28                 | 3,370     | 0.1      |
|  | 4.7              | 50                 | 6,081     | 0.1      |
|  | 2.55             | 33                 | 3,995     | 0.1      |
|  | 20.75            | 197                | 23,598    | 0.5      |
| 国 小 計  | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 32<br>4銘柄          | 37,046    | < 0.7%>  |
| ユーロ (イタリア) BENI STABILI SPA IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUIZ  | 千口               | 千ユーロ               | 千円        | %        |
|  | 45.35            | 22                 | 2,701     | 0.1      |
|  | 11.9             | 7                  | 891       | 0.0      |
| 国 小 計  | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 57.25<br>2銘柄       | 3,593     | < 0.1%>  |
| ユーロ通貨計   | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 209.15<br>31銘柄     | 339,309   | < 6.5%>  |
| 合 計  | 口数、金額<br>銘柄数<比率> | 5,229,084<br>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<br>5,172,139 | %<br>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。<br>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。<br>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   | 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<br>(除く日本) (円ベース)<br>(ベンチマーク) |           | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|-----------------|-------------|-----------|-----------|---|-----------|--------------------|-----------|
|                 | 税込み<br>分配金  | 期中<br>騰落率 | 期中<br>騰落率 | 期中<br>騰落率                                   | 期中<br>騰落率 |                    |           |
| 1期末(2017年6月15日) | 円<br>10,729 | 円<br>0    | %<br>7.3  | %<br>7.8                                    | %<br>99.1 | 百万円<br>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。

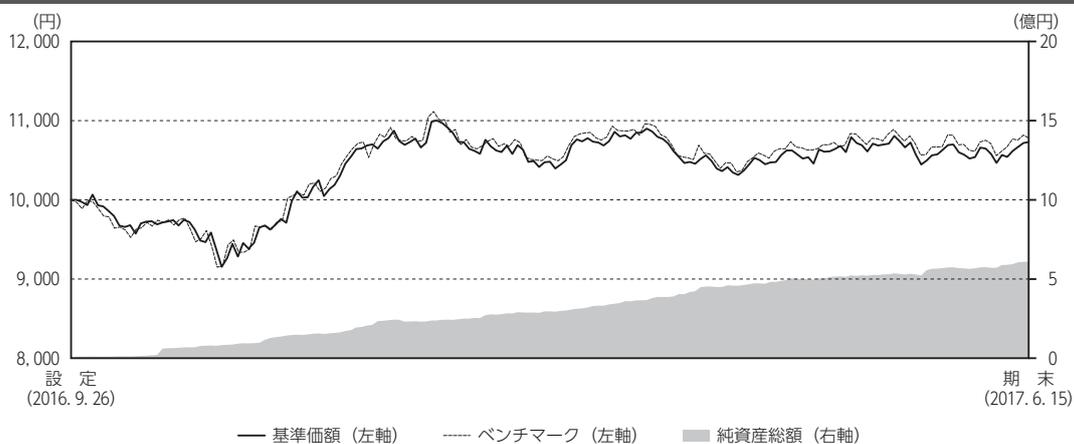
(注3) 投資信託証券組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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<br>(除く日本) (円ベース) |         | 投資信託<br>証 券<br>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。

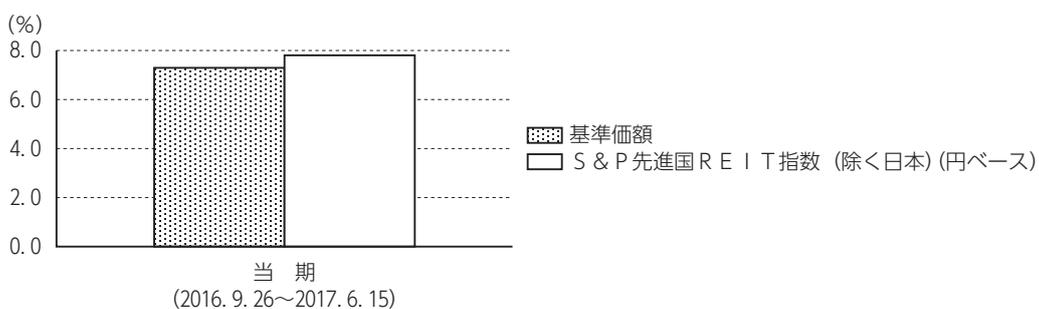
## ベンチマークとの差異について

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<br>~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<br>(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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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。