

ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）
ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）
ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）
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）
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）
ダイワJ-REITインデックス（ダイワSMA専用）
ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）
ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

運用報告書（全体版）

第2期

（決算日 2018年6月15日）

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/>

<4660>
<4661>
<5694>
<5695>
<4662>
<5696>
<5697>
<4663>
<5698>
<5699>

ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果を東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）	
マザーファンドの運用方法	投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。 イ. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。 ロ. ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。 ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。		
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率 マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等をを中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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

運用報告書(全体版) 第2期 (決算日 2018年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			T O P I X		株 式 組入比率	株 式 先物比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6 月15日)	10,274	30	3.0	1,588.09	2.2	99.1	1.2	4
2 期末 (2018年 6 月15日)	11,678	110	14.7	1,789.04	12.7	99.7	1.2	99

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) 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 3) 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1) 期末の基準価額は分配金込みです。

(注2) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークはTOPIXです。

基準価額・騰落率

期首：10,274円

期末：11,678円 (分配金110円)

騰落率：14.7% (分配金込み)

基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%		%	%	%
(期首)2017年 6 月15日	10, 274	—	1, 588. 09	—	99. 1	1. 2
6 月末	10, 443	1. 6	1, 611. 90	1. 5	99. 1	0. 8
7 月末	10, 488	2. 1	1, 618. 61	1. 9	99. 1	0. 8
8 月末	10, 482	2. 0	1, 617. 41	1. 8	98. 9	1. 0
9 月末	10, 934	6. 4	1, 674. 75	5. 5	98. 7	1. 2
10月末	11, 523	12. 2	1, 765. 96	11. 2	98. 3	1. 7
11月末	11, 693	13. 8	1, 792. 08	12. 8	98. 7	1. 3
12月末	11, 869	15. 5	1, 817. 56	14. 4	98. 8	1. 1
2018年 1 月末	11, 990	16. 7	1, 836. 71	15. 7	99. 0	1. 0
2 月末	11, 547	12. 4	1, 768. 24	11. 3	98. 9	1. 0
3 月末	11, 308	10. 1	1, 716. 30	8. 1	98. 0	2. 0
4 月末	11, 709	14. 0	1, 777. 23	11. 9	98. 5	1. 5
5 月末	11, 516	12. 1	1, 747. 45	10. 0	98. 3	1. 7
(期末)2018年 6 月15日	11, 788	14. 7	1, 789. 04	12. 7	99. 7	1. 2

(注 1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注 2) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

投資環境について

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

国内株式市況

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

前期における「今後の運用方針」

当ファンド

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

トピックス・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

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

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

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

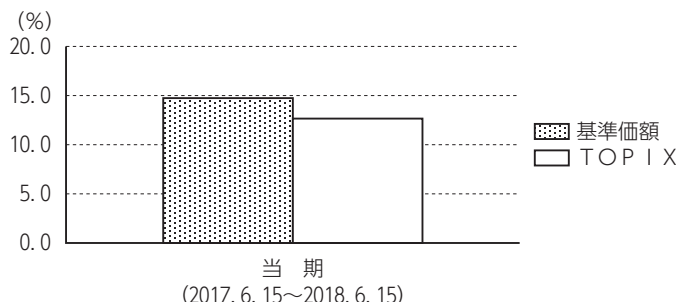
ベンチマークとの差異について

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

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は110円といたしました。
収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年6月16日	～2018年6月15日
当期分配金（税込み）（円）		110
対基準価額比率（％）		0.93
当期の収益（円）		100
当期の収益以外（円）		10
翌期繰越分配対象額（円）		1,677

- （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。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	104.45円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	1,665.18
(d) 分配準備積立金	18.28
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	1,787.92
(f) 分配金	110.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	1,677.92

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 6. 16～2018. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	38円	0. 335%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11, 289円です。
(投 信 会 社)	(23)	(0. 205)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(12)	(0. 108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0. 022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0. 001	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0. 000)	
(先 物)	(0)	(0. 001)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 007	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 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	39	0. 343	

(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。

ダイワTOP I Xインデックス (ダイワSMA専用)

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数 千口	金 額 千円	□ 数 千口	金 額 千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	85,375	99,283	131	142

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

項 目	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	18, 152, 826千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	138, 653, 602千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0. 13

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1)ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

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

(注) 平均保有割合0.0%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

種 類	当 期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
株式	百万円	百万円	百万円
	4	28	305

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

種 類	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
	買 付 額
株式	百万円 24

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	0千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(B) / (A)	1.6%

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

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期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

期首保有額	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

(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	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千円	千円	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	4,268	89,512	100,612

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	100,612	99.9
コール・ローン等、その他	129	0.1
投資信託財産総額	100,742	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	100,742,039円
コール・ローン等	128,185
トピックス・インデックス・マザーファンド（評価額）	100,612,054
未収入金	1,800
(B) 負債	1,062,783
未払収益分配金	938,926
未払信託報酬	121,939
その他未払費用	1,918
(C) 純資産総額（A－B）	99,679,256
元本	85,356,999
次期繰越損益金	14,322,257
(D) 受益権総口数	85,356,999口
1万口当り基準価額（C／D）	11,678円

*期首における元本額は4,045,067円、当期中における追加設定元本額は81,311,932円、同解約元本額は0円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は11,678円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	△ 2,696,521円
売買益	836
売買損	△ 2,697,357
(B) 信託報酬等	△ 131,349
(C) 当期損益金（A＋B）	△ 2,827,870
(D) 前期繰越損益金	156,052
(E) 追加信託差損益金	17,933,001
（配当等相当額）	(3,178,825)
（売買損益相当額）	(14,754,176)
(F) 合計（C＋D＋E）	15,261,183
(G) 収益分配金	△ 938,926
次期繰越損益金（F＋G）	14,322,257
追加信託差損益金	17,847,645
（配当等相当額）	(3,093,469)
（売買損益相当額）	(14,754,176)
分配準備積立金	194,063
繰越損益金	△ 3,719,451

(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	891,581円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	14,213,550
(d) 分配準備積立金	156,052
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	15,261,183
(f) 分配金	938,926
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	14,322,257
(h) 受益権総口数	85,356,999口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	110円

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

<補足情報>

当ファンド（ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用））が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2017年9月19日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15日）現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を12～19ページに併せて掲載いたしました。

トピックス・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
日本郵政	179.1	238,416	1,331	日本電信電話	56.4	303,984	5,389
シャープ	53.2	204,817	3,849	三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	372.8	277,247	743
キーエンス	3.2	198,637	62,074	ＫＤＤＩ	59.1	178,294	3,016
トヨタ自動車	26.6	188,102	7,071	三井住友フィナンシャルＧ	33.3	148,072	4,446
ＳＧホールディングス	50.9	124,683	2,449	トヨタ自動車	18.2	124,784	6,856
東海旅客鉄道	5.6	115,872	20,691	ソニー	29.1	124,663	4,283
リクルートホールディングス	42.3	113,477	2,682	ファナック	4.7	117,096	24,914
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	112.1	80,042	714	野村ホールディングス	178.7	116,441	651
本田技研	20.5	74,724	3,645	信越化学	9.9	109,821	11,093
ソフトバンクグループ	8.1	71,112	8,779	武田薬品	17.4	109,501	6,293

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

組入資産明細表

下記は、2018年6月15日現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンド（130,458,954千円）の内容です。

(1)国内株式

銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			安藤・間	49.9	48,652	大豊建設	25	16,150	東亜建設	5.8	16,663
極洋	3.8	14,288	東急建設	25.5	27,616	前田建設	45.4	58,384	若築建設	5.3	8,909
日本水産	71.3	38,858	コムシスホールディングス	21.9	64,670	興村組	9.8	37,093	東洋建設	22.4	11,334
マルハニチロ	12.1	52,695	ミサワホーム	7.5	7,342	東鉄工業	7.9	26,820	五洋建設	74.1	54,463
カネコ種苗	5.4	8,586	高松コンストラクショングループ	4.2	13,818	浅沼組	27	10,530	世紀東急	12.6	9,450
サカタのタネ	9.5	40,090	東建コーポレーション	2.5	24,550	戸田建設	72	71,136	福田組	2.4	16,680
ホクト	6.5	12,961	ヤマウラ	8.4	7,593	熊谷組	10.5	40,425	住友林業	38.4	63,744
鉱業 (0.3%)			大成建設	63.5	391,795	北野建設	19	7,163	日本基礎技術	19	7,106
日鉄鉱業	2.1	11,634	大林組	189.5	216,409	三井ホーム	11	7,843	日成ビルド工業	11	13,035
三井松島	5	8,015	清水建設	194.6	215,811	矢作建設	10.8	9,720	巴コーポレーション	21.9	11,015
国際石油開発帝石	305.9	359,279	飛島建設	77.1	14,957	ピーエス三菱	12.5	7,362	大和ハウス	187.6	743,458
石油資源開発	9.1	25,516	長谷工コーポレーション	74.2	119,387	日本ハウスＨＬＤＧＳ	17.5	9,642	ライト工業	12.3	13,776
K&Oエナジーグループ	4	7,484	松井建設	10.5	9,996	大東建託	22.8	414,732	積水工業	203.9	393,017
建設業 (3.1%)			鹿島建設	280	251,720	新日本建設	8.6	11,438	日特建設	10.3	6,427
ショーボンドＨＤ	6	45,840	不動産テトラ	55	10,945	ＮＩＰＰＯ	15.1	31,377	ユアテック	9.9	9,078
ミライト・ホールディングス	18.9	33,736	鉄建建設	4.1	12,222	東亜道路	1.7	6,545	中電工	7.9	23,052
タマホーム	10.3	10,876	西松建設	14.2	45,014	前田道路	18.5	40,848	関電工	24.5	30,306
TATERU	6.4	13,811	三井住友建設	45.2	34,623	日本道路	1.8	10,800	きんでん	41.1	74,719

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
東京エネシス	8.2	10,373	コカ・コーポラズHD	40.3	181,753	パルプ・紙 (0.3%)			ダイセル	78.2	95,795
トーエネック	1.9	6,374	サントリー食品インター	43.5	213,150	特種東海製紙	3.4	15,776	住友ベークライト	47	50,290
住友電設	5	9,995	ダイドーグループHD	3.1	19,902	王子ホールディングス	245	175,175	積水化学	121.3	225,132
日本電設工業	9.4	23,114	伊藤園	19.1	100,084	日本製紙	22.8	42,567	日本ゼオン	49.4	68,517
協和エクシオ	22.6	67,212	キーコーヒー	7	15,372	三菱製紙	14.6	9,475	アイカ工業	16	64,800
九電工	12.6	69,174	日清オイリオグループ	6.6	21,846	北越紀州製紙	31.3	18,498	宇部興産	29.7	91,624
三機工業	13.9	15,276	不二製油グループ	15.4	62,370	中越パルプ	4	7,196	積水樹脂	9.3	22,487
日揮	54.3	118,428	J-オイルミルズ	3.2	12,768	大王製紙	23	36,570	タキロンシアアイ	14.8	9,812
中外炉工業	3.7	10,504	キッコーマン	43.1	238,774	レンゴー	56.1	57,165	旭有機材	5.6	12,583
太平電業	4.5	13,680	味の素	129.7	279,827	トーモク	4.2	9,219	日立化成	28.6	67,867
高砂熱学	17	35,071	キューピー	31.7	88,664	ザ・パック	4.4	16,720	ニチバン	3.4	10,200
明星工業	12.6	10,609	ハウス食品G本社	22.1	88,289	化学 (7.4%)			リケンテクノス	16.4	9,446
大気社	7.4	24,531	カゴメ	22.9	86,791	クラレ	97.4	161,002	大倉工業	16	8,496
ダイダン	5	13,495	アリアケジャパン	5.3	51,834	旭化成	369.2	533,863	積水化成成品	9.2	11,233
日比谷総合設備	7.7	17,063	ニチレイ	27.2	78,934	共和レザー	7.8	8,104	群栄化学	2.3	8,349
東芝プラントシステム	13.3	34,500	東洋水産	30.6	124,389	昭和電工	39.7	196,912	ダイキョーニシカワ	11.8	20,390
OSJBHD	33.7	9,773	日清食品HD	24.4	202,032	住友化学	432	278,208	竹本容器	3.5	10,902
東洋エンジニア	11.4	9,348	永谷園ホールディングス	8	12,000	住友精化	2.5	14,475	日本化薬	36.9	44,206
千代田化工建	42.1	38,521	フジコ	6.4	18,777	日産化学	34.3	176,645	カーリットホールディングス	12.5	12,812
新興ブランテック	13	13,143	ロックフィールド	6.9	13,717	ラサ工業	4	12,420	日本精化	9.2	11,408
食料品 (4.4%)			日本たばこ産業	350.7	1,109,965	クレハ	5.1	37,791	扶桑化学工業	5.8	16,634
日本製粉	18.4	35,199	ケンコーマヨネーズ	4.3	18,210	テイカ	5.1	12,984	ADEKA	24.5	46,648
日清製粉G本社	68.3	163,646	わらべや日洋HD	4.1	11,074	石原産業	11.8	13,216	日油	22.7	78,428
昭和産業	5.2	15,579	北の達人コーポ	17.7	15,204	日本曹達	40	24,320	ハリマ化成グループ	6.9	6,292
中部飼料	7.6	15,686	ユーグレナ	23.2	21,088	東ソー	85.2	153,956	花王	139.3	1,204,527
フィード・ワン	44	10,384	理研ビタミン	2.3	10,407	トクヤマ	17.4	64,641	第一工業製薬	14	10,724
東洋精糖	8.6	10,629	繊維製品 (0.7%)			セントラル硝子	11.7	27,822	三洋化成	3.6	18,252
三井製糖	4.8	17,088	片倉工業	8.2	10,955	東亞合成	33.7	43,911	大日本塗料	8.7	13,380
塩水港精糖	32.5	8,547	グンゼ	4.7	33,887	大阪ソーダ	5.9	18,290	日本ペイントHOLD	46.1	216,670
日新製糖	3.8	8,094	東洋紡	21.8	40,177	関東電化	15.1	16,066	関西ペイント	62.4	141,710
森永製菓	13.5	72,360	ユニチカ	18.6	12,276	デンカ	21.3	82,750	中国塗料	17.8	18,992
江崎グリコ	16	88,960	富士紡ホールディングス	3.6	14,022	信越化学	98.1	1,023,183	日本特殊塗料	4.7	11,364
不二家	4.3	11,012	倉敷紡績	59	21,358	日本カーバイド	3.5	7,080	藤倉化成	12.4	8,494
山崎製パン	46.4	130,523	シキボウ	6.4	8,422	堺化学	4.4	12,786	太陽ホールディングス	4.4	20,504
モロゾフ	1.7	11,373	日本毛織	16.3	17,881	エア・ウォーター	48	101,280	DIC	22.7	82,287
亀田製菓	3.8	23,218	帝国繊維	6.9	16,332	太陽日酸	45.5	76,713	サカタインクス	13.7	20,878
寿スブリッツ	5.7	35,226	帝人	46.2	96,373	日本化学工業	3.4	14,161	東洋インキSCホールディン	54	32,724
カルビー	26.1	101,398	東レ	431	382,641	日本バーカライズン	29.7	50,222	T&K TOKA	5.7	6,999
森永乳業	11.5	49,392	サカイ オーベックス	3.2	7,392	高圧ガス	11.1	11,211	富士フイルムHLDGS	116.7	503,210
六甲バター	4.2	10,210	住江織物	2.1	5,991	四国化成	9.2	14,168	資生堂	105.8	951,459
ヤクルト	33.5	249,575	アツギ	9.8	11,818	戸田工業	2.1	6,092	ライオン	79.3	168,988
明治ホールディングス	37.6	362,088	ダイニック	7.4	7,851	ステラ ケミファ	3.5	13,650	高砂香料	3.5	13,177
雪印メグミルク	13.8	41,317	セーレン	13.9	26,396	保土谷化学	2.4	8,688	マンダム	10.6	37,842
プリマハム	41	26,445	ソート	9.6	10,022	日本触媒	9	74,610	ミルボン	7.7	39,039
日本ハム	24.5	111,107	東海染工	5.5	7,986	大日精化	4.8	17,256	ファンケル	13.8	78,936
丸大食品	32	15,744	小松精練	11.3	11,390	カネカ	79	84,056	コーセー	9.7	249,872
S Foods	4.3	19,156	ワコールホールディングス	15.4	52,437	三菱瓦斯化学	49.1	133,159	シーズ・ホールディングス	7.5	37,425
伊藤ハム米久HLDGS	36	34,632	ホギメディカル	7.5	37,500	三井化学	53.4	162,603	ポーラ・オルビスHD	24.5	127,890
サッポロホールディングス	20.9	59,774	TSIホールディングス	22.3	18,241	JSR	59.5	114,299	ノビアホールディングス	3.8	31,350
アサヒグループホールディン	119.4	680,818	三陽商会	4.9	11,853	東京応化工業	10.3	43,569	エステー	4.7	14,194
キリンHD	273	821,457	三ツ井ホールディングス	35	31,325	大阪有機化学	6.2	9,548	コニシ	9.9	18,552
宝ホールディングス	44.2	64,532	ゴールドウイン	3.6	34,776	三菱ケミカルHLDGS	395.6	383,811	長谷川香料	7.9	17,395
オエノホールディングス	31.1	13,590	デサント	14	28,924	KHネオケム	9.4	30,926	小林製薬	15.8	157,210

銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
荒川化学工業	6.3	12,159	ゼリア新薬工業	12.2	27,999	ニチアス	32	45,984	アルファCO	2.9	4,848
メック	4.9	10,094	第一三共	162.1	651,155	ニチハ	8.8	38,412	SUMCO	52.4	123,087
日本高純度化学	4.1	10,106	キョーリン製薬HD	14.7	34,456	鉄鋼 (1.1%)			川田テクノロジーズ	1.4	10,892
タカラバイオ	15.1	37,115	大幸薬品	4.2	9,038	新日鐵住金	251.7	567,583	東洋製罐グループHD	36.9	69,003
JCU	7.2	19,137	ダイト	3.9	14,508	神戸製鋼所	102.8	117,397	ホッカンホールディングス	19	7,030
新田セラチン	10.3	8,672	大塚ホールディングス	117.5	643,195	中山製鋼所	9.1	6,424	横河ブリッジHLDGS	10.8	28,695
デクセリアルズ	14.7	16,199	大正製薬HD	12.5	154,625	合同製鐵	3.7	8,436	駒井ハルテック	3.1	7,371
アース製薬	4.3	24,553	ペプチドリーム	26.1	126,976	JFEホールディングス	149.6	341,237	三和ホールディングス	52.7	63,714
北興化学	13.2	8,632	石油・石炭製品 (0.7%)			日新製鋼	16.1	25,454	文化シャッター	17.6	17,899
クミアイ化学	26.6	22,716	日本コークス工業	62	7,316	東京製鐵	30.8	31,015	三協立山	8.2	12,078
日本農業	15	9,945	昭和シエル石油	52.4	84,206	共英製鋼	6.6	14,909	アルインコ	8	8,640
アキレス	5.3	12,290	ニチレキ	8.7	10,727	大和工業	11.6	41,407	LIXILグループ	82.1	189,897
有沢製作所	11.2	13,697	ユシロ化学	5.3	8,755	東京鐵鋼	4.5	7,524	日本フィルコン	11.7	7,172
日東電工	42.6	370,875	ピービー・カストロール	3.3	5,553	大阪製鐵	3.8	8,337	ノーリツ	12.6	23,788
レック	3.6	16,596	富士石油	16.7	6,462	淀川製鋼所	7.3	21,288	長府製作所	6.6	15,655
藤森工業	4.8	18,216	MORESCO	4.5	8,514	東洋鋼板	14.9	10,683	リンナイ	9.9	101,772
ジェイ・エス・ピー	3.5	12,057	出光興産	47.6	179,928	丸一鋼管	19.3	72,664	岡部	12.3	12,386
エフピコ	4.8	30,768	JXTGホールディングス	896.8	685,155	大同特殊鋼	9.7	51,604	ジーテクト	6.8	13,328
東馬	4.7	9,461	コスモエネルギーHLDGS	16.5	60,885	日本高周波	7.5	6,247	東プレ	10.4	31,356
信越ポリマー	11.8	13,310	ゴム製品 (0.8%)			日本冶金工	50	16,950	高周波熱練	11.4	11,764
東リ	22.3	7,871	横浜ゴム	31.3	75,495	山陽特殊製鋼	6.9	19,071	東京製鋼	5.1	9,878
ニフコ	20.5	78,002	東洋ゴム	33.6	56,212	愛知製鋼	2.8	12,250	パイオラックス	8.7	23,690
日本バルカー	4.9	16,145	ブリヂストン	187.1	827,730	日立金属	60.7	73,325	エイチワン	6.3	8,271
ユニ・チャーム	119.8	414,747	住友ゴム	57.9	107,578	日本金属	2.5	5,035	日本発条	54.2	59,023
医薬品 (4.7%)			藤倉ゴム	10.5	7,255	大平洋金属	3.8	15,162	立川ブラインド	5.2	7,529
			オカモト	20	25,120	新日本電工	36.5	12,008	三益半導体	5.5	9,966
			ニッタ	5.6	24,220	栗本鉄工所	3.9	7,686	機械 (5.1%)		
			住友理工	9.6	11,222	三菱製鋼	5.8	13,258	日本製鋼所	18.6	57,102
			三ツ星ベルト	14	19,768	日本精練	1.6	7,128	三浦工業	24.4	69,076
			パンドーラ化学	11.1	14,962	シンシントン	19.4	9,409	タクマ	19.5	25,798
			ガラス・土石製品 (1.0%)			非鉄金属 (0.9%)			ツガミ	15	16,170
			日東紡績	8.7	22,811	大紀アルミニウム	11.9	8,710	オークマ	6.2	37,324
			旭硝子	56.9	258,041	日本軽金属HD	161.3	40,970	東芝機械	31	17,701
			日本板硝子	28.6	31,631	三井金属	15.2	78,280	アマダホールディングス	81.4	92,144
			日本山村硝子	55	10,120	東邦亜鉛	3.4	14,739	アイダエンジニア	13.7	16,097
			日本電気硝子	24.2	76,956	三菱マテリアル	36.1	113,534	滝澤鉄工所	4.8	8,947
			住友大阪セメント	110	58,300	住友鉱山	71.7	330,537	FUJII	16.4	33,587
			太平洋セメント	35.7	144,763	DOWAホールディングス	14	51,030	牧野フライス	27	24,462
			日本ヒューム	11.8	10,631	古河機金	9.6	15,696	オーエスジー	25.3	61,276
			日本コンクリート	25.6	9,318	大阪チタニウム	6.6	11,213	旭ダイヤモンド	17.7	15,310
参天製薬	107	220,313	アジアパイルHD	10.7	7,971	東邦チタニウム	11.4	11,457	DMG森精機	30.1	50,929
扶桑薬品	3.7	11,003	東海カーボン	52.3	110,928	UACJ	8.5	21,921	ソディック	12.8	13,785
日本ケミファ	1.7	7,956	日本カーボン	3.2	21,920	古河電工	18.8	75,952	デイスコ	7.7	153,769
ツムラ	20	78,100	東洋炭素	4.1	14,104	住友電工	207.7	351,532	日東工器	4	11,076
日医工	14.3	24,281	ノリタケ	3.4	17,816	フジクラ	67	50,652	パンチ工業	6.4	7,705
キッセイ薬品工業	10.1	31,360	TOTO	43.7	246,031	昭和電線HLDGS	9.9	7,999	豊和工業	4.3	4,523
生化学工業	11.9	18,683	日本硝子	66.8	134,401	タツタ電線	12.7	7,950	OKK	5.5	6,864
栄研化学	9.4	23,960	日本特殊陶業	47.8	146,029	リョービ	6.9	25,081	石川製作所	2.1	4,204
鳥居薬品	3.7	10,511	MAIRUWA	2.1	19,026	アールステイ	8.7	9,143	東洋機械金属	10	7,220
JCRファーマ	4.1	29,233	品川リファクトリーズ	2.1	8,053	アサヒHD	10.3	21,866	島精機製作所	7.2	39,384
東和薬品	2.7	17,253	黒崎播磨	1.3	8,229	金属製品 (0.6%)			オプトラン	5.2	21,294
富士製薬工業	2.2	9,108	ニッカトー	10.1	11,625	宮地エンジニアリングG	2.7	5,756	ヤマシンフィルタ	9.5	10,925
沢井製薬	11.3	56,500	アジミンコーポレート	5.4	14,288	トーカロ	16.5	21,697	日阪製作所	10.3	10,835

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
やまびこ	10.9	15,794	マースエンジニアリング	4.1	10,832	ダブル・スコープ	8.9	16,812	ユニデンホールディングス	24	8,256
平田機工	2.1	15,603	福島工業	3.6	18,216	ダイヘン	31	22,568	アルパイン	13.4	27,992
ナブテスコ	30.6	104,805	ダイコク電機	4.2	8,064	ヤーマン	8.6	17,114	スミダコーポレーション	7	8,785
三井海洋開発	5.8	16,837	竹内製作所	9.4	22,419	JVCケンウッド	46.8	15,584	アイコム	3.9	10,608
レオン自動機	5.6	12,180	アモノ	17.8	47,846	第一精工	3.4	7,106	リオン	3.6	8,272
SMC	17.8	696,870	JUKI	8.8	10,463	日新電機	13.6	15,517	本多通信工業	6.7	6,432
ホンカワミクロン	2.4	17,616	サンデンホールディングス	8.1	12,546	大崎電気	14.1	12,196	船井電機	9.5	6,365
ユニオンツール	3	11,400	マックス	8.8	12,988	オムロン	59.9	331,247	横河電機	56.3	113,050
オイレス工業	7.1	16,514	グローリー	16.7	53,607	日東工業	10.1	20,654	新電元工業	2.1	12,117
日精エーエスピー	2	11,880	新晃工業	6.3	12,070	I D E C	7.5	21,142	アズビル	16.6	88,478
サトールディングス	7.8	25,077	大和冷機工業	10.1	13,079	ジーエス・ユアサコーポ	102	51,612	日本光電工業	24.1	73,625
技研製作所	3.9	10,171	セガサミーホールディングス	56	110,152	メルコホールディングス	3.1	12,880	共和電業	19.5	8,658
日精樹脂工業	6.4	8,102	日本ピストンリング	4	9,356	日本電気	72.8	227,500	堀場製作所	11.3	93,225
小松製作所	273.4	927,646	リケン	2.7	16,092	富士通	584	413,647	アドバンテスト	32.2	74,768
住友重機械	31.5	120,960	T P R	6.3	17,917	沖電気	22.4	28,067	エスベック	5.4	11,885
日立建機	26.4	98,208	ツバキ・ナカシマ	6	15,936	電気興業	3.9	13,201	キーエンス	27.8	1,878,168
巴工業	4.5	10,224	ホシザキ	17.9	206,029	サンケン電気	34	20,672	日置電機	3.6	16,740
井関農機	6.1	12,462	大豊工業	5.1	6,757	アイホン	4.9	8,638	シスメックス	44.1	458,199
TOWA	5.4	6,998	日本精工	115.1	136,969	ルネサスエレクトロニクス	32.4	35,931	日本マイクロニクス	11.9	12,185
丸山製作所	5	9,135	N T N	125.4	58,436	セイコーエプソン	84.8	164,851	メガチップス	4.9	14,587
北川鉄工所	3.4	9,370	ジェイテクト	58.2	91,781	ワコム	45.3	28,720	OBARA GROUP	3.3	20,592
ローツェ	3.3	8,045	不二越	5.2	26,884	アルバック	13.1	61,701	コーセル	8.8	12,135
クボタ	302.9	558,244	日本トムソン	19.8	18,295	E I Z O	5.4	25,272	イリソ電子工業	4.8	32,832
三菱化工機	3.5	7,392	T H K	35.3	123,550	ジャパンディスプレイ	121.1	18,043	オプテックスグループ	9.6	28,704
月島機械	11.8	20,520	ユーシン精機	5.9	8,342	日本信号	15.9	17,394	千代田インテグレ	3	7,095
帝国電機製作所	6.3	8,977	イーグル工業	7	12,733	京三製作所	17	14,093	レーザテック	12.4	40,052
新東工業	14.3	14,571	日本ピラー工業	7.2	11,368	能美防災	8.1	20,355	スタンレー電気	43	169,635
渋谷工業	5.2	18,278	キッツ	25.2	23,713	ホーチキ	5.1	11,107	岩崎電気	5.1	8,501
アイチコーポレーション	9.9	7,078	マキタ	73.7	378,081	エレコム	5.3	14,341	ウシオ電機	32.3	45,478
小森コーポレーション	13.7	18,686	日立造船	42.5	22,567	パナソニック	646.5	1,012,419	ヘリオステクノH	8.7	6,377
鶴見製作所	5	9,430	三菱重工業	94	390,664	シャープ	53.2	149,119	日本セラミック	5.9	17,788
住友精密	27	10,098	I H I	43.2	176,040	アンリツ	41.6	64,480	古河電池	6.3	5,777
酒井重工業	1.8	7,029	スター精密	9.3	16,730	富士通ゼネラル	17.8	29,904	山一電機	4.8	8,001
荏原製作所	23.1	81,427	電気機器 (13.6%)			ソニー	379.3	2,065,288	図研	5.1	9,338
西島製作所	8	8,256	日清紡ホールディングス	34.4	43,068	T D K	29.4	337,806	日本電子	22	25,014
北越工業	7.7	8,285	イビデン	34.3	62,426	帝国通信工業	7.1	9,407	カシオ	45.5	77,486
ダイキン工業	77.4	1,029,033	コニカミノルタ	129.5	137,529	タムラ製作所	23.2	17,632	ファナック	53.8	1,217,494
オルガノ	2.8	8,638	ブラザー工業	69	158,493	アルプス電気	48.5	135,897	日本シイエムケイ	12	8,916
トーヨーカネツ	2.7	10,165	ミネベアミツミ	105.1	205,470	池上通信機	40	6,240	エンプラス	2.8	8,960
栗田工業	30	91,800	日立	1,362.1	1,113,979	パイオニア	100.2	16,132	大真空	4.1	5,953
椿本チエイン	31	27,311	三菱電機	567.3	862,863	日本電波工業	13.4	8,241	ローム	25.4	244,602
アネスト岩田	10.3	11,700	富士電機	170	145,690	日本トリム	1.5	7,177	浜松ホトニクス	40.1	188,871
ダイフク	29	149,930	東洋電機製造	3.6	6,840	ローランドディー・ジー	3.6	9,050	三井ハイテック	8.4	11,894
加藤製作所	3.2	9,232	安川電機	66	276,870	フォスター電機	7	11,753	新光電気工業	22	21,824
油研工業	3.5	9,800	シノフォニクステクノロジー	40	16,240	クラリオン	33	9,504	京セラ	93	608,220
タダノ	27.2	39,358	明電舎	49	19,992	S M K	18	7,164	太陽誘電	24.7	72,494
フジテック	17.3	24,877	オリジン電気	4	9,928	ヨコオ	4.7	10,222	村田製作所	59.3	1,081,632
C K D	16	32,432	山洋電気	2.8	25,004	ホシデン	14.5	14,746	ユースン	15.5	11,253
キトー	5.3	12,820	デンヨー	5.6	10,740	ヒロセ電機	9.2	134,136	双葉電子工業	8.8	17,696
平和	17.7	46,427	東芝テック	40	26,800	日本航空電子	14	25,130	北陸電気工業	5.3	6,937
理想科学工業	6	13,542	マブチモーター	15	76,800	T O A	7.4	8,717	ニチコン	17.1	24,367
S A N K Y O	13.4	59,898	日本電産	68.3	1,186,371	マクセルホールディングス	11.2	19,992	日本ケミコン	4.7	19,998
日本金銭機械	6.8	8,676	東光高岳	3.9	7,601	古野電気	9.6	9,100	K O A	8.1	21,667

銘柄	2018年6月15日現在 株数 評価額		銘柄	2018年6月15日現在 株数 評価額		銘柄	2018年6月15日現在 株数 評価額		銘柄	2018年6月15日現在 株数 評価額	
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
市光工業	9.6	14,284	ショーワ	15.2	31,403	河合楽器	3.3	18,183	南海電鉄	25.2	81,774
小糸製作所	34.3	268,226	T B K	22.4	12,185	クリナップ	8.3	7,046	京阪ホールディングス	23.7	95,155
ミツバ	11.6	12,493	エクセディ	6.6	23,958	ピジョン	34.2	189,126	名古屋鉄道	42.4	128,684
SCREENホールディングス	10.9	93,958	豊田合成	19.9	57,530	キングジム	10.1	11,130	山陽電鉄	5	13,770
キャノン電子	5.6	13,372	愛三工業	10.7	11,106	リントック	12.5	40,125	日本通運	20.9	187,264
キャノン	303.4	1,138,356	ヨロズ	6.6	11,662	イトーキ	15.8	10,396	ヤマトホールディングス	94.5	323,190
リコー	171.4	173,799	エフ・シー・シー	9.3	29,248	任天堂	34.9	1,317,824	山九	13.7	86,036
象印マホービン	10.3	16,366	シモノ	22.7	374,777	三菱鉛筆	9.3	20,934	丸全昭和運輸	22	11,572
東京エレクトロン	37.9	723,132	テイ・エス テック	13.1	63,207	タカラスタンダード	11.7	21,960	センコーグループHLDGS	32.6	30,122
輸送用機器 (8.8%)			ジャムコ	3.1	7,402	コクヨ	27	54,054	トナミホールディングス	1.6	11,776
トヨタ紡織	16.5	35,211	精密機器 (1.7%)			ナカバヤシ	13.3	9,828	ニッコンホールディングス	18.8	57,904
ユニプレス	10.8	25,434	テルモ	86.8	583,296	グローブライド	4.1	17,609	福山通運	8.2	48,216
豊田自動織機	45.7	296,593	日機装	20.1	24,019	オカムラ	19.9	32,198	セイノーホールディングス	40	85,680
モリタホールディングス	9.2	20,994	島津製作所	67.6	211,926	美津濃	5.7	23,569	日立物流	12	36,120
三井工業	9.9	7,335	長野計器	7.5	10,057	電気・ガス業 (1.7%)			丸和運輸機関	3.2	12,864
デンソー	125.9	696,856	ブイ・テクノロジー	1.4	31,570	東京電力HD	452.7	229,518	九州旅客鉄道	44.9	161,191
東海理化電機	13.5	28,566	東京計器	5.3	6,635	中部電力	174.4	295,695	SGホールディングス	50.9	126,690
三井 E&SHD	20.1	29,727	東京精密	10.2	40,953	関西電力	231.7	376,512	海運業 (0.2%)		
川崎重工業	43.5	148,552	マニー	6.9	36,087	中国電力	73.7	107,602	日本郵船	44.3	103,662
名村造船所	19.5	9,574	ニコン	96.1	173,172	北陸電力	55.9	64,788	商船三井	33.8	99,372
日本車輛	26	7,358	トプコン	30.3	59,842	東北電力	134.1	184,253	川崎汽船	24.7	56,093
三菱ロジスネクスト	7.2	8,920	オリンパス	84.1	347,333	四国電力	50.9	80,931	NS 千代田海運	2.6	5,655
日産自動車	664.2	724,642	理研計器	5.9	15,275	九州電力	124.4	156,992	飯野海運	28.9	14,854
いすゞ自動車	163.9	250,111	タムロン	4.7	9,691	北海道電力	56.7	43,659	空運業 (0.6%)		
トヨタ自動車	688.4	5,205,680	HOYA	113.9	732,718	沖縄電力	11.8	27,069	日本航空	99.4	426,823
日野自動車	80.9	97,969	ノーリツ鋼機	6.2	12,319	電源開発	44.6	129,250	ANAホールディングス	104.5	465,025
三菱自動車工業	210	185,220	エー・アンド・ディ	11	12,221	イーレックス	10.7	12,604	倉庫・運輸関連業 (0.2%)		
エフテック	5.4	8,062	シチズン時計	66.1	48,253	東京瓦斯	120.9	362,035	トランコム	1.7	14,178
武蔵精密工業	6.3	25,452	リズム時計	4	9,488	大阪瓦斯	108.9	256,296	日新	4.9	12,088
日産車体	22.3	22,991	メニコン	8.4	25,284	東邦瓦斯	28.2	107,019	三菱倉庫	17.5	41,650
新明和工業	24.1	31,474	セイコーHD	8.5	21,564	北海道瓦斯	39	12,051	三井倉庫 HOLD	37	13,209
極東開発工業	10.3	17,437	ニプロ	39	51,402	西部瓦斯	6.8	20,604	住友倉庫	34	23,630
日信工業	11.7	24,102	その他製品 (2.1%)			静岡ガス	16.6	17,944	渋沢倉庫	6.7	12,381
トピー工業	4.8	15,360	パラマウントベッドHD	6	28,950	メタウォーター	3.2	10,032	東陽倉庫	29.2	10,774
ティラド	2.4	8,952	S H O - B I	13.7	6,110	陸運業 (4.4%)			日本トランスシティ	19	10,298
曙ブレーキ	30.2	10,298	二ホンフラッシュ	4.4	12,685	東武鉄道	59	212,695	東洋埠頭	6.5	11,284
タチエス	9.7	18,818	前田工織	7	13,706	相鉄ホールディングス	17.5	61,425	上組	32.3	79,619
N O K	27.8	58,102	アートネイチャー	9	6,453	東京急行	153.2	310,842	キューソー流通システム	3	8,280
フタバ産業	19.2	15,014	パンダインナムコHLDGS	58.5	270,270	京浜急行	78.4	153,350	近鉄エクスプレス	10.1	24,270
K Y B	5.9	31,093	S H O E I	2.8	11,284	小田急電鉄	83.2	205,920	内外トランスライン	5.5	8,844
大同メタル工業	8.1	9,355	パイロットコーポレーション	9.9	63,360	京王電鉄	31.4	171,444	情報・通信業 (7.4%)		
プレス工業	30.5	19,794	萩原工業	5.2	9,718	京成電鉄	39.1	154,640	NEC ネットエスアイ	5.8	14,627
太平洋工業	13.2	23,799	トップパン・フォームズ	12.2	13,773	富士急行	8.2	28,782	システナ	19.2	24,076
ケーヒン	12.8	29,376	フジオールインターナショナル	12.6	51,786	東日本旅客鉄道	102.2	1,132,376	デジタルアーツ	3.1	18,414
河西工業	8.1	12,028	タカラトミー	24.8	23,708	西日本旅客鉄道	51.1	419,122	新日鉄住金 S O L	8.7	26,578
アイシン精機	46.8	261,612	大建工業	5.2	13,603	東海旅客鉄道	50.8	1,220,216	キューブシステム	8.5	8,678
マツダ	176.8	251,940	凸版印刷	155	139,035	西武ホールディングス	71.7	239,671	コア	4.9	7,002
今仙電機製作所	7.6	9,576	大日本印刷	72	177,768	鴻池運輸	8.2	14,473	ソフトクリエイトHD	5.5	9,806
本田技研	508.9	1,797,943	共同印刷	2.5	7,420	西日本鉄道	15.3	47,812	T I S	18.6	97,464
スズキ	112.4	722,507	N I S S H A	12	27,000	ハマキョウレックス	4.5	16,087	電算システム	5.5	11,792
SUBARU	176.1	596,802	宝印刷	6.9	12,930	サカイ引越センター	3.2	18,464	グリー	34.5	21,838
安永	3.3	6,860	アシックス	56.3	99,256	近鉄グループHLDGS	52.2	247,428	コーエーテクモHD	8.7	19,409
ヤマハ発動機	79.5	240,090	ヤマハ	38.4	228,096	阪急阪神HLDGS	71.3	339,031	三菱総合研究所	2.9	14,427

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
K L a b	11.1	18,281	東京放送HD	31.2	78,748	TOKAIホールディングス	30.3	34,329	菱電商事	5	9,265
ポルトゥガル・ビートル	5.1	12,474	日本テレビHLDS	50.2	94,928	三洋貿易	4.1	9,011	岩谷産業	12	47,160
ネクソン	125.1	220,676	テレビ朝日HD	15.1	36,708	ウイン・パートナーズ	5.5	7,777	すてきなイスグループ	6.1	8,277
アイスタイル	15	18,330	スカパーJSATHD	40.7	21,123	シップヘルスケアHD	11.2	47,488	極東貿易	20	9,320
エイチーム	4.5	11,911	テレビ東京HD	4.9	16,488	コマダホールディングス	10.8	23,382	イワキ	14	6,104
テクノスジャパン	8.9	9,220	日本BS放送	5.5	7,700	小野建	5.4	10,886	三愛石油	14.6	20,921
コロプラ	19	14,668	ワイヤレスゲート	4.9	7,158	佐島電機	8.7	9,091	稲畑産業	12.9	20,665
ブロードリーフ	30.3	18,240	コネクシオ	4.3	8,578	伯東	4.1	7,035	ワキタ	12.3	14,870
ハーツユニテッドグループ	4.5	7,645	日本通信	79.2	16,077	コンドーテック	8.5	8,772	東邦ホールディングス	15.4	42,534
メディアドゥHLDS	3	7,134	日本電信電話	397.7	2,082,357	ナガイレーベン	8.2	23,993	サンゲツ	17.9	40,454
ティアーガイア	5.6	17,444	KDDI	497.3	1,510,797	三菱食品	5.3	15,979	ミツウロコグループ	9.3	8,202
豆蔵ホールディングス	7.1	7,433	光通信	6.9	140,346	松田産業	5.8	9,709	シナネンホールディングス	3.2	8,992
ガンホー・オンライン・エンター	153	43,299	NTTドコモ	394.9	1,128,821	第一興商	8.1	41,796	伊藤忠エネクス	11.5	12,707
GMOペイメントゲートウェイ	4.6	54,510	エムティーアイ	10.2	6,405	メディアパルHD	54	135,972	サンリオ	15.5	32,472
インターネットイニシアティブ	9.7	22,785	GMOインターネット	21	59,892	萩原電機HLDS	2.8	9,352	サンワテクノス	5.3	8,617
さくらインターネット	9.7	8,371	カドカワ	16.8	21,168	アズワン	4.3	34,658	リョーサン	7	26,670
SRAホールディングス	3.7	10,992	ゼンリン	10.3	26,944	ドウシシャ	6.3	15,712	新光商事	6.9	12,316
システムインテグレータ	7.5	8,220	松竹	3.6	59,076	小津産業	4.9	10,510	トーホー	4.3	11,111
朝日ネット	17.2	9,150	東宝	36.3	136,851	丸文	7.3	6,628	三信電気	5.5	10,659
コムチュア	4.1	12,587	東映	2	23,380	ハピネット	4.7	6,627	東陽テクニカ	10	9,000
gumi	8.1	6,690	NTTデータ	174.9	225,096	日本ライフライン	16.3	43,455	モスフードサービス	7.4	24,716
アカツキ	1.6	7,256	DTT	6.2	27,745	エクセル	3.2	8,156	加賀電子	5	14,130
LINE	17.2	74,390	スクウェア・エニックスHD	25.9	143,745	マルカキカイ	4	8,044	PALTAC	7.9	49,138
AOI TYO HOLDINGS	6.4	9,318	シーイーシー	3.8	16,834	IDOM	18.2	12,467	ヤマシタヘルスケアHLDS	5.7	8,561
マクロミル	7.5	18,750	カプコン	24.1	61,238	進和	4.7	12,079	ヤマタネ	5.6	12,336
野村総合研究所	35.9	206,066	ジャズテック	7	8,288	ダイエー	4.1	10,500	日鉄住金物産	4.4	25,256
インテジホールディングス	8.5	9,970	SCSK	13.3	71,421	シークス	7	15,344	トラスコ中山	11.9	34,164
クレスコ	1.9	6,431	アイネス	10.8	12,690	伊藤忠	409.9	874,931	オートバックスセブン	21.1	42,664
フジ・メディアHD	57.9	109,546	TKC	5.6	24,584	丸紅	455.2	398,800	加藤産業	8.5	33,192
オービック	17.7	170,451	富士ソフト	7.9	37,564	高島	3.3	7,207	イノテック	7.2	10,216
ジャストシステム	9.6	22,579	NSD	9.3	23,668	長瀬産業	31.3	58,562	イエローハット	5.3	17,861
ヤフー	409.1	155,867	コナミホールディングス	22.7	125,531	蝶理	4.1	7,884	日伝	5.3	11,426
トレンドマイクロ	27.3	176,631	JBCCホールディングス	10.6	12,836	豊田通商	62.3	245,462	北沢産業	33.1	8,903
日本オラクル	9.3	82,026	ミロク情報サービス	5.3	16,430	兼松	23.3	38,212	因幡電機産業	6.8	32,674
フューチャー	9.7	14,016	ソフトバンクグループ	251.8	2,095,983	ツカモトコーポレーション	6.8	8,527	パイテックホールディングス	3.8	9,169
CAC HOLDINGS	7.6	8,329	卸売業 (4.8%)			三井物産	459.7	882,624	ミスミグループ本社	65.1	205,716
オービックビジネスC	3	25,470	エレマテック	2.9	7,624	日本紙パルプ	2.9	15,051	スズケン	24.7	119,795
伊藤忠テクノソリューション	26	52,338	JALUX	2.6	8,112	日立ハイテクノロジーズ	19.3	91,482	ジェコス	5.1	5,339
アイティフォー	13.7	18,453	あらた	3.1	21,235	カメイ	7.2	12,513	小売業 (5.1%)		
大塚商会	33.8	155,818	東京エレクトロンデバイス	4.1	8,507	スターゼン	2.5	16,275	ローソン	14	97,160
サイボウズ	15.4	8,377	フィールズ	5.9	6,012	山善	20.9	24,390	サンエー	4.3	24,553
電通国際情報S	4.1	14,637	双日	325	133,900	住友商事	351.1	670,601	カワチ薬品	4.8	11,649
デジタルガレージ	10.4	49,556	アルフレッサホールディングス	60.3	166,005	内田洋行	3.5	11,532	エービーシー・マート	10.2	65,484
イエムシステムズ	6.4	7,084	横浜冷凍	15.4	16,200	三菱商事	391.5	1,254,757	ハードオフコーポレーション	6.7	7,155
ウェザーニューズ	2.7	9,058	アルコニックス	6.6	11,893	第一実業	3.1	10,695	アスクル	5.8	20,010
C I J	13.8	9,715	神戸物産	3.8	20,064	キャンマーケティングJPN	16.1	37,657	ゲオホールディングス	10.8	16,880
WOWOW	3	10,260	ペーパーフードサービス	4.1	20,828	西華産業	4	10,680	アダストリア	9	13,239
ネットワンシステムズ	23.4	44,483	あいホールディングス	9.4	24,393	菱洋エレクトロ	6.9	12,495	くらコーポレーション	3.4	26,180
アルゴグラフィックス	3.2	11,632	ディーブイエックス	4.8	6,710	ユアサ商事	5.1	19,125	バルグループHLDS	3.1	8,704
マーベラス	9.9	9,365	ダイワボウHD	4.9	30,821	神鋼商事	2	6,150	エディオン	21.1	24,096
エイベックス	10.2	15,544	マクニカ・富士エHLDS	11	20,658	阪和興業	10.3	45,732	サードコーポレーション	11.6	8,143
日本ユニシス	15.7	43,536	バイタルKSKHD	10.3	11,989	正栄食品	3.4	13,090	ワッツ	6.7	7,550
兼松エレクトロニクス	3.7	14,707	UKCホールディングス	4.5	10,314	カナデン	8.4	12,751	ハローズ	3	7,740

銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在		銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円	
あみやき亭	2.2	11,066	サイゼリヤ	9	23,121	プレナス	6.2	11,594	紀陽銀行	19.8	37,679
ひらまつ	16.8	8,820	VTホールディングス	20.7	11,736	ミニストップ	4.6	10,589	ほくほくフィナンシャルG	34.7	56,248
大黒天物産	1.7	9,299	ポプラ	11.6	10,242	アークス	9.9	30,393	広島銀行	78.3	63,266
ハニーズホールディングス	7.8	7,839	ユニテッドアローズ	6.9	28,324	パローホールディングス	12.9	33,965	山陰合同銀行	31.2	32,541
アルペン	4.5	11,137	ハイデイド高	7.6	21,082	ベルク	2.7	16,146	中国銀行	36.8	46,809
クオール	6.5	14,943	コロワイド	19	58,330	ファーストリテイリング	7.4	379,990	伊予銀行	76	60,496
ジンス	4	27,240	ピーシーデポコーポ	9.7	5,577	サンドラッグ	23.8	115,787	百十四銀行	58	22,040
ビックカメラ	33.5	58,859	壱番屋	3.9	20,358	サックスパーホールディング	6.7	6,753	四国銀行	9	13,194
DCMホールディングス	27.9	29,713	スギホールディングス	12.2	81,618	ペルーナ	14.2	21,456	阿波銀行	43	32,035
MonotaRO	20.1	97,183	ヴィア・ホールディングス	15.8	11,376	銀行業 (6.8%)			大分銀行	3.4	13,311
アークランドサービスHD	5.2	12,942	スクロール	18.2	11,083				宮崎銀行	3.9	14,254
J. フロントリテイリング	66.1	120,235	ヨンドーホールディングス	6	17,202	じもとホールディングス	55.2	9,825	佐賀銀行	3.8	9,614
ドット・日レスHD	9.9	22,453	ユニ・ファミリーマートHD	18	216,900	めぶきフィナンシャルG	286.3	112,515	十八銀行	38	11,590
マツモトキヨシHLDGS	23.2	121,800	木曾路	7.5	21,540	東京きらぼしFG	7.6	19,904	沖縄銀行	5.2	22,698
ブロンコビリー	3.5	16,310	千趣会	15.4	8,423	九州フィナンシャルG	89	48,327	琉球銀行	10.8	18,781
スタートトゥデイ	55.3	242,214	タカキユー	35.9	7,790	ゆうちょ銀行	161.7	217,324	セブン銀行	208	72,384
物語コーポレーション	1.8	20,196	ケーヨー	14.4	8,049	富山第一銀行	19.1	9,588	みずほフィナンシャルG	7,581.8	1,454,947
ココカラファイン	5.9	44,132	上新電機	6.8	26,384	コンコディア・フィナンシャル	333.9	214,029	高知銀行	8.6	10,775
三越伊勢丹HD	103.8	147,915	日本瓦斯	10.6	66,886	西日本フィナンシャルHD	36	47,232	山口フィナンシャルG	63	83,979
ウエルシアHD	15	90,450	ロイヤルホールディングス	10	30,500	関西みらいFG	26.5	23,267	名古屋銀行	4.1	16,687
グリエイトSDH	8.5	28,432	いなげや	6.9	13,034	33FG	7.5	17,070	北洋銀行	78.5	30,536
ジョイフル本田	8.8	33,176	島忠	13.9	48,650	新生銀行	49	86,191	愛知銀行	2.3	12,213
鳥貴族	2.7	7,403	チヨダ	6.6	17,483	あおぞら銀行	33.2	145,914	中京銀行	3.1	7,266
ホットランド	5.3	7,488	ライフコーポレーション	4.2	11,835	三菱UFJフィナンシャルG	3,913.8	2,578,020	大光銀行	3.8	8,683
すかいらーく	35	59,465	リンガーハット	7.2	18,972	りそなホールディングス	611.7	399,501	愛媛銀行	9.1	11,739
綿半ホールディングス	3.2	11,088	MrMaxHD	9.9	6,880	三井住友トラストHD	109.7	506,265	トマト銀行	8.3	12,989
ユニテッド・スーパーマ	18.1	26,299	AOKIホールディングス	10.6	17,744	三井住友フィナンシャルG	422.1	1,911,268	京葉銀行	45	22,545
あさひ	5.4	7,851	オークワ	9	10,188	第四銀行	6.5	31,005	栃木銀行	29.1	11,989
日本調剤	2.3	6,900	コメリ	8.3	24,036	北越銀行	5.9	14,366	北日本銀行	3.4	9,537
コスモス薬品	2.9	69,455	青山商事	10.4	41,184	千葉銀行	196	169,540	東和銀行	10.9	13,319
セブン&アイ・HLDGS	233.5	1,154,891	しまむら	6.5	75,335	群馬銀行	107.5	68,585	福島銀行	13.5	10,152
薬王堂	2.7	10,516	高島屋	86	81,270	武蔵野銀行	8.4	30,450	大東銀行	8.3	10,956
グリエイト・レストランツ・ホ	16.3	26,194	松屋	12.5	21,062	千葉興業銀行	21.9	11,125	トモニホールディングス	45.4	23,063
ツルハホールディングス	12.2	196,664	エイチ・ツー・オーリテイ	25.7	47,339	筑波銀行	33.8	9,666	フィデアホール	63.5	11,049
サンマルクホールディングス	4.1	11,836	丸井グループ	53.9	129,360	七十七銀行	16.3	42,314	池田泉州HD	52.1	20,579
トリドールホールディングス	7.1	20,710	アクシアルリテイリング	5.2	21,658	青森銀行	4.7	16,144	証券・商品先物取引業 (0.9%)		
TOKYO BASE	5.9	6,100	イオン	214.2	516,329	秋田銀行	3.7	11,895	FPG	20.8	31,740
ダイユー・リックHLDGS	9.1	10,355	イズミ	10.1	71,407	山形銀行	6.2	15,332	SBIホールディングス	64.1	194,864
クヌのオキHLDGS	4.6	36,294	平和堂	11.1	29,736	岩手銀行	3.6	15,894	ジャフコ	7.9	37,762
スシローグローバルHLDGS	5.9	40,651	フジ	7	16,345	東邦銀行	47.2	20,107	大和証券G本社	470.7	305,437
LIXILビバ	6.6	12,302	ヤオコー	6.5	39,975	東北銀行	8.9	12,513	野村ホールディングス	959	542,985
総合メディカル	5.3	12,974	ゼビオホールディングス	7.5	13,762	ふくおかフィナンシャルG	224	135,296	岡三証券グループ	46	25,944
ノジマ	10.2	26,866	ケーズホールディングス	48.5	61,013	静岡銀行	143.7	157,638	丸三証券	19.4	19,749
ライトオン	7.3	7,446	GENKY DRUGSTORES	2.5	11,212	十六銀行	6.8	20,740	東洋証券	38	9,956
良品計画	7.4	299,700	アインホールディングス	7.8	64,818	スルガ銀行	58.4	61,670	東海東京HD	58.7	43,614
アドヴァン	6.9	6,610	元気寿司	3.5	12,267	八十二銀行	93.8	47,369	水戸証券	26.2	10,558
アルビス	2.5	8,387	ヤマダ電機	185.7	103,434	山梨中央銀行	37	17,575	いちよし証券	13.6	17,231
コジマ	17.3	9,826	アークランドサカモト	9.5	15,998	大垣共立銀行	8.3	24,335	松井証券	24.5	25,872
ローナン商事	8	21,840	ニトリホールディングス	22.3	436,634	福井銀行	5	12,500	マネックスG	60.4	35,938
ワタミ	8.5	12,384	吉野家ホールディングス	18.4	40,884	北國銀行	6.2	29,946	カブドットコム証券	35.6	13,706
ドンキホーテホールディング	36.3	210,903	松屋フーズ	3	11,250	清水銀行	3	6,618	極東証券	8.2	12,234
西松屋チェーン	12.5	16,725	サガミチェーン	10.9	15,576	滋賀銀行	46	27,416	岩井コスモホールディング	7.9	11,636
ゼンショーホールディングス	29.4	83,643	関西スーパーマーケット	5.7	6,954	南都銀行	6.3	18,799	藍澤證券	14.1	11,294
幸楽苑ホールディングス	7.3	12,957	王将フードサービス	3.9	24,492	百五銀行	50	23,550	保険業 (2.3%)		
						京都銀行	21	116,340	かんぽ生命保険	21.7	53,360

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
SOMPOホールディングス	109.7	506,046
アニコムホールディングス	4.1	18,060
MS & AD	145.3	517,122
SONY F H	45.3	96,489
第一生命HLDGS	315.1	652,257
東京海上HD	209.9	1,169,982
T&Dホールディングス	170.4	299,478
アドバンスクリエイト	4.3	9,309
その他金融業 (1.2%)		
全国保証	15.9	82,521
アルヒ	6.1	13,694
クレディセゾン	41.4	73,443
芙蓉総合リース	6.4	50,688
興銀リース	10.5	31,552
東京証券チェリー	11.5	75,555
日本証券金融	23.7	14,978
アイフル	97.5	34,417
リコーリース	4.3	16,017
イオンフィナンシャルサービス	39.3	98,760
アコム	116.5	51,027
ジャックス	7.2	17,546
オリコ	123.9	19,080
日立キャピタル	15	43,800
アプラスフィナンシャル	66.6	7,326
オリックス	372.4	693,781
三菱UFJリース	139.7	99,047
日本取引所グループ	161.5	351,908
イー・ギャラリー	4.8	10,920
NECキャピタルソリューション	3.5	7,070
不動産業 (2.5%)		
いちご	81	43,659
日本駐車場開発	82.9	15,170
ヒューリック	117.2	139,936
三栄建築設計	3	5,772
野村不動産HLDGS	37.6	95,804
三重交通グループHD	14.6	7,431
サムティ	5.8	13,195
日本商業開発	4.6	8,970
フルカスコーポレーション	8.4	15,128
ユニホールディングス	7.3	15,899
日本管理センター	5.4	7,435
フージャースHD	17.1	14,039
オープンハウス	9.4	64,202
東急不動産HD	134	107,334
飯田GHD	46.2	100,947
パーク24	32.3	96,706
バラカ	3	7,575
三井不動産	280	767,900
三菱地所	416.6	851,113
平和不動産	10.1	22,644
東京建物	61	94,184
ダイビル	14.6	16,979
京阪神ビルディング	12.2	12,200
住友不動産	135	577,800

銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
大京	9	22,527
テオーシー	20.6	17,551
レオパレス21	67.5	45,090
スターツコーポレーション	7.8	21,434
フジ住宅	11.7	11,547
空港施設	11.1	7,048
ゴールドクレスト	5	9,545
日本エスリード	3.4	6,820
日神不動産	9.6	6,950
日本エスコン	11.8	7,976
タカラレーベン	28	11,760
サンヨーハウジング名古屋	8	9,808
イオンモール	36.1	74,943
カチタス	7.4	33,485
トーチセイ	8.4	11,533
エヌ・ティ・ティ都市開発	34.9	42,612
サンフロンティア不動産	9.1	12,239
エフ・ジェー・ネクスト	7.6	8,215
グランディハウス	19.2	9,849
日本空港ビルディング	16.2	91,044
サービス業 (4.6%)		
日本工営	4.1	12,669
L I F U L L	20.1	14,853
ジェイエス・リクルートメント	4.9	10,745
日本M&Aセンター	38.1	134,493
タケエイ	8.3	10,076
トラスト・テック	3	11,805
コシダホールディングス	14.7	24,710
パナソニックグループ	5.7	10,014
C D S	6.6	9,537
リングアンドモベーション	11.1	15,828
G C A	8.6	7,937
エス・エム・エス	11	46,860
パーソルホールディングス	50.5	124,634
リニカル	5.3	11,861
クックパッド	19.1	10,925
スタジオアリス	3.3	8,692
ジミックホールディングス	4.8	11,246
綜合警備保障	21.6	114,264
カカココム	41.3	104,902
ディップ	7.9	22,372
オプトホールディング	5.8	12,951
ツクイ	14.7	13,759
エムスリー	57.4	266,623
アウトソーシング	17.1	36,576
ウェルネット	7.7	9,286
ワールドホールディングス	2.1	7,255
ディー・エヌ・エー	29.4	62,739
博報堂D Y HLDGS	74.8	136,136
ぐるなび	10.4	9,921
ファンコミュニケーションズ	18.3	13,761
WDBホールディングス	3	9,720
ティア	10.3	11,185
バリューコマース	7.6	11,194

銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
インフォマート	28.9	44,881
JPホールディングス	21.5	8,514
EPSホールディングス	8.9	21,938
プレステージ・インター	12.6	20,487
アミューズ	4	12,220
ドリームインキュベータ	3	7,182
クイック	4.3	7,967
T A C	23.5	8,060
ケネディクス	74.3	50,895
電通	66.3	348,738
びあ	2.1	13,482
イオンファンタジー	2	13,780
ネクシースグループ	2.8	4,734
みらかホールディングス	15.6	50,934
アルプス技研	5.7	14,033
オリエンタルランド	64.1	766,636
ダスキン	14.2	39,561
明光ネットワークジャパン	7.8	9,906
ファルコホールディングス	7.1	13,482
ラウンドワン	17.4	32,103
リゾートトラスト	22.8	47,059
ビー・エム・エル	7.5	21,892
りらいあコミュニケーション	9.6	15,715
リソー教育	10.6	8,755
ユー・エス・エス	65.7	141,189
サイバーエージェント	34.7	230,061
楽天	278.9	202,927
テ・オー・ダブリュ	10.2	9,016
セントラルスポーツ	2.4	9,756
フルキャストホールディングス	5.5	15,537
テクノプロ・ホールディング	10.4	75,712
イー・ガーディアン	3.3	11,071
ジャパンマテリアル	16.1	28,980
ベクトル	7.1	16,436
アサンテ	4.3	9,348
N・フィールド	3.8	6,460
M&Aキャピタルパートナー	1.4	14,896
エスクローA J	11.1	5,383
日本ビューホテル	8.7	12,684
リクルートホールディングス	418.5	1,331,667
日本郵政	307.8	382,595
ベルシステム24HLDGS	10	19,320
ソラスト	3.8	13,585
リログループ	30.3	89,263
東祥	3.7	15,688
エイチ・アイ・エス	8.4	30,492
共立メンテナンス	9.7	60,334
イチネンホールディングス	7.7	11,118
建設技術研究所	7.9	11,289
スバル興業	1.1	7,194
東京テアトル	5.6	8,103
よみうりランド	1.6	7,624
東京都競馬	4.4	20,834
常盤興産	6.5	12,103

銘柄	2018年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
カナモト	8.3	29,589
東京ドーム	22.4	22,310
西尾レントオール	5.7	20,748
トランス・コスモス	6.5	17,465
乃村工務社	13	32,422
藤田観光	2.8	9,730
KNT-CTホールディングス	4.3	7,043
日本管財	6.1	14,023
トーカイ	5.4	13,008
セコム	57.3	473,871
セントラル警備保障	3.5	16,520
丹青社	12.4	18,848
メイテック	6.3	31,878
応用地質	6.9	10,315
船井総研ホールディング	11.9	32,034
オオバ	18.8	11,994
学究社	5.5	10,186
ベネッセホールディングス	19.5	81,120
イオンディライト	6.8	27,030
ニチイ学館	11.7	15,221
ダイセキ	9.4	31,678
合計		千株 千円
株数、金額		68,591 144,768,159
銘柄数<比率>		1,499銘柄 <98.7%>

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

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

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

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入状況

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

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
(注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券へ465,200株を貸付けています。

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第29期（決算日 2017年9月19日）

（計算期間 2016年9月21日～2017年9月19日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

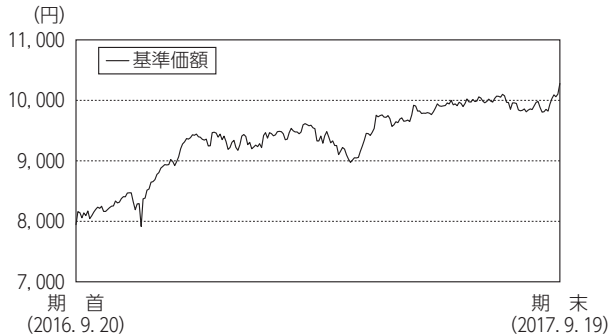
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	比	比
	円	%		%	%	%
(期首) 2016年 9月20日	7,944	—	1,316.97	—	99.7	0.2
9 月 末	8,045	1.3	1,322.78	0.4	98.5	1.5
10 月 末	8,471	6.6	1,393.02	5.8	98.6	1.4
11 月 末	8,937	12.5	1,469.43	11.6	99.0	0.9
12 月 末	9,248	16.4	1,518.61	15.3	99.4	0.6
2017年 1 月 末	9,267	16.7	1,521.67	15.5	99.4	0.5
2 月 末	9,358	17.8	1,535.32	16.6	99.5	0.7
3 月 末	9,298	17.0	1,512.60	14.9	97.4	2.5
4 月 末	9,420	18.6	1,531.80	16.3	98.4	1.7
5 月 末	9,649	21.5	1,568.37	19.1	98.6	1.3
6 月 末	9,926	24.9	1,611.90	22.4	99.1	0.8
7 月 末	9,971	25.5	1,618.61	22.9	99.1	0.8
8 月 末	9,968	25.5	1,617.41	22.8	98.9	1.0
(期末) 2017年 9月19日	10,279	29.4	1,667.88	26.6	99.2	0.7

(注 1) 騰落率は期首比。
(注 2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

- ◆基準価額等の推移について
【基準価額・騰落率】
期首：7,944円 期末：10,279円 騰落率：29.4%
【基準価額の主な変動要因】
T O P I X が上昇したことを受けて、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。
- ◆投資環境について
○国内株式市況
国内株式市況は、期首より、日米の金融政策や米国大統領選挙に関する見方が交錯し、一進一退で推移しました。2016年11月は、米国大統領選挙でのトランプ氏勝利を受けて一時的に投資家のリスク回避姿勢が強まり株価は下落しましたが、その後はトランプ氏の景気刺激政策への期待から、上昇基調となりました。12月半ば以降は、株価の急上昇に対する警戒感に加えてトランプ氏の政策に対する期待と不透明感が交錯し、一進一退で推移しました。2017年4月に入ると、北朝鮮の地政学リスクの高まりが懸念され、株価は下落しました。しかし4月後半からは、地政学リスク悪化の一巡に加えて、フランス大統領選挙で中道派のマクロン氏が極右政党の候補者を抑えて当選したことが好感されて、株価は上昇しました。6月以降は、欧米の中央銀行の金融引き締めペースの見方が交錯し、株価は横ばい圏で推移しました。8月に入ると、再び北朝鮮に関わる地政学リスクが高まったことや、米国物価統計の弱含みにより米国の年内利上げ観測が後退したこと、また対米ドルでの円高が進行したことなどが影響し、株価は軟調に推移しました。期末にかけては、北朝鮮の地政学リスクがやや後退したことや、衆議院解散観測を受けての安倍政権に対する期待の高まりから上昇しました。
- ◆前期における「今後の運用方針」
当ファンドの運用の基本方針に基づき、T O P I X に連動する投資成果をめざして運用を行なっております。
- ◆ポートフォリオについて
株式を中心に、一部T O P I X 先物取引も利用し、株式組入比率(株式先物を含む。)につきましては、期を通じておおむね100%程度を維持しました。
株式ポートフォリオは、最適化の手法(株価変動を数理的にいくつかの要因に分解し、それに基づいて、ポートフォリオがT O P I X と同じように変動するよう、銘柄、株数を決定するシステムの手法)を用いて構築しています。
期中、資金変動への対応、新規上場等のT O P I X の構成の変化への対応のため、随時、株式の売買を行ないました。
- ◆ベンチマークとの差異について
ベンチマーク(T O P I X)の騰落率は26.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は29.4%となりました。
・保有している株式の配当金について、ベンチマークが配当落ちしていることに対して、ファンドには配当金が計上されているため、ベンチマークと乖離しました。
・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T O P I X の騰落率との差異、先物取引の影響、売買コスト等がかい離の要因として挙げられます。

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

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

(注 2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1)株 式 (2016年 9月21日から2017年 9月19日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) () 内は株式分割、合併等による増減分で、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

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

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2016年 9月21日から2017年 9月19日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
水産・農林業 (0.1%)					東洋建設	22.4	17.5	8,522		カルビー	24.1	25.8	100,878	
極洋	35	3.6	12,024		五洋建設	73.1	69.4	44,971		森永乳業	59	58	50,054	
日本水産	77.9	82.7	50,943		大林道路	9.1	—	—		六甲バター	4	3.5	8,403	
マルハニチロ	14	12	39,780		世紀東急	13.3	13.8	8,735		ヤクルト	35.3	34	275,400	
カネコ種苗	—	4.4	6,661		福田組	12	2.2	13,376		明治ホールディングス	39.4	37.2	325,128	
サカタのタネ	10.7	9.7	30,749		住友林業	44.6	42.1	70,643		雪印メグミルク	15.7	13.8	44,298	
ホクト	7	5.8	11,263		日本基礎技術	26.2	14.2	5,367		プリマハム	46	44	34,188	
鉱業 (0.3%)					日成ビルド工業	22	21	12,600		日本ハム	47	45	141,525	
日鉄鉱業	20	1.9	15,390		パナホーム	25	—	—		丸大食品	36	29	15,805	
三井松島	57	6.1	8,936		大和ハウス	193	185.5	713,989		S Foods	4.6	3.9	16,614	
国際石油開発帝石	338.9	327.6	364,127		ライト工業	13.4	12.1	13,382		伊藤ハム米久 HLDGS	41.9	36.2	37,648	
日本海洋掘削	2.5	3.3	6,860		積水ハウス	217.3	189.8	354,071		サッポロホールディングス	20.2	20.3	64,757	
石油資源開発	10.2	9.2	20,332		日特建設	18.6	—	—		アサヒグループホールディングス	122.7	117.7	539,536	
K&O エナジーグループ	5.1	4.1	7,605		ユアテック	12	11	8,855		ケリンHD	281	269.9	683,116	
建設業 (3.2%)					西部電気工業	—	3.3	8,045		宝ホールディングス	47.3	45.5	48,412	
ショーボンドHD	6.8	5.9	37,465		中電工	7.5	6.3	19,309		オエノンホールディングス	60	32.6	9,225	
ミライト・ホールディングス	20.4	18.9	24,796		関電工	26	26	30,654		コカ・コーラボトラーズJ	22.1	39.5	148,915	
タマホーム	—	10.5	7,528		きんでん	35.1	42.4	74,200		コカ・コーライストジャパン	23.2	—	—	
安藤・間	44.7	47.5	35,530		東京エネシス	8	6.7	7,865		サントリイ食品インター	45.5	43	223,600	
東急建設	22	23.1	20,397		トーエネック	11	9	5,823		ダイドーグループHD	3.4	2.7	14,580	
コムシスホールディングス	27.1	23.8	60,499		住友電設	6	4.8	9,681		伊藤園	19.3	18.6	71,331	
ミサワホーム	8.9	9.3	8,723		日本電設工業	9.9	9.5	21,508		キーコーヒー	6.7	5.6	12,443	
高松コンストラクショング	4.8	4.4	13,332		協和エクシオ	25.3	24.1	50,393		日清オイリオグループ	36	36	26,820	
東建コーポレーション	2.8	2.5	33,625		九電工	12.2	12.6	55,125		不二製油グループ	17.5	17	51,595	
大成建設	340	319	373,868		三機工業	14.3	14.1	17,554		J-オイルミルズ	32	2.6	10,517	
大林組	196	188.9	245,570		日揮	65	58.4	101,148		キッコーマン	49	43.1	151,496	
清水建設	199	193.6	232,126		中外炉工業	34	32	7,008		味の素	138.1	129.3	280,516	
飛鳥建設	62	71.9	11,360		太平電業	10	9	12,834		キュービー	33.9	32	85,152	
長谷工コーポレーション	76.8	73.1	103,144		高砂熱学	18.6	17.3	32,420		ハウス食品G本社	21.9	23	80,845	
松井建設	10.3	8.3	8,026		明星工業	13.9	13.3	10,001		カゴメ	23.1	22.4	77,504	
銭高組	18	—	—		大気社	7.4	7.5	21,832		アリアケジャパン	5.6	5.3	43,566	
鹿島建設	306	277	287,526		ダイダ	10	10	13,530		ニチレイ	71	29.9	86,411	
不動産トラ	51.3	54.3	9,882		日比谷総合設備	8.6	6.3	15,025		東洋水産	31.5	30.3	126,048	
鉄建建設	43	40	14,320		東芝プラントシステム	9.9	10.1	19,594		日清食品HD	27.2	24.5	171,990	
西松建設	75	71	43,026		OSJBHD	—	27.8	9,007		永谷園ホールディングス	8	8	10,504	
三井住友建設	255.1	240.9	29,389		東洋エンジニア	35	37	10,508		フジッコ	6.9	6	16,410	
大豊建設	27	25	12,750		千代田化工建	47	44	26,928		ロックフィールド	8.4	7	14,476	
前田建設	40	42	54,684		新興プランテック	13.5	13.8	13,496		日本たばこ産業	361.7	347.1	1,291,212	
ナカノフドー建設	15.2	—	—		食品 (4.5%)					ケンコーマヨネーズ	—	4	11,204	
奥村組	58	48	39,696		日本製粉	43	17.4	30,693		わらべや日洋HD	4.1	4.1	11,492	
東鉄工業	8	7.8	28,353		日清製粉G本社	71	67.2	131,644		ユーグレナ	22.5	22.3	25,488	
浅沼組	37	27	8,802		昭和産業	27	24	14,880		ミヨシ油脂	95	6.7	9,668	
戸田建設	76	74	61,716		中部飼料	8.5	7.7	15,684		理研ビタミン	—	1.9	8,255	
熊谷組	97	103	34,711		フィード・ワン	54.7	49.9	12,874		繊維製品 (0.7%)				
北野建設	33	20	8,840		日本甜菜糖	49	3.6	8,773		片倉工業	8.9	7.5	9,997	
三井ホーム	13	11	7,865		三井製糖	28	4.6	17,480		グンゼ	49	46	24,610	
矢作建設	10.1	10	9,640		塩水港精糖	—	29.9	7,534		東洋紡	244	231	45,969	
ピーエス三菱	20.3	14.7	8,981		日新製糖	—	3.1	6,215		ユニチカ	233	186	15,438	
日本ハウスHLDGS	27.2	17.9	10,185		森永製菓	61	12.7	82,550		富士紡ホールディングス	37	3.3	12,408	
大東建託	24.4	22.7	444,806		中村屋	23	1.9	9,633		倉敷紡績	58	60	17,580	
新日本建設	10.7	8.6	7,275		江崎グリコ	15.1	15.9	89,835		シキボウ	121	69	11,040	
NIPPPO	15	13	29,666		不二家	51	4.4	10,846		日本毛織	18.6	15.5	15,376	
東亜道路	27	17	7,089		山崎製パン	48.4	45.6	93,662		ダイドーリミテッド	14.7	20.8	9,152	
前田道路	19	19	43,206		第一屋製パン	44	—	—		帝国繊維	7	6.6	15,318	
日本道路	20	20	12,280		モロゾフ	21	1.4	10,892		帝人	248	46.8	107,218	
東亜建設	61	5.8	12,255		亀田製菓	3.9	3.6	17,532		東レ	439	423.5	459,709	
若築建設	92	53	10,176		寿スピリッツ	5.7	6.4	23,712		サカイオーベックス	58	3.8	8,987	

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
住江織物	37	22	7,590	—	大日精化	24	24	26,256	—	星光PMC	5.6	4.4	5,319	—
芦森工業	47	—	—	—	カネカ	82	76	66,044	—	小林製薬	18.2	15.9	105,417	—
アツギ	89	76	9,652	—	三菱瓦斯化学	102	54.9	150,426	—	荒川化学工業	6.2	5.6	15,388	—
セーレン	16.1	15.5	31,666	—	三井化学	259	265	184,175	—	メック	—	6.3	11,642	—
ソトー	—	6.8	7,874	—	J S R	56.8	58.4	126,319	—	日本高純度化学	3.1	4.3	11,820	—
東海染工	—	51	7,191	—	東京応化工業	12.2	10.9	45,235	—	タカラバイオ	12.2	17.1	26,111	—
小松精練	13.2	10.6	9,497	—	大阪有機化学	—	6.6	9,266	—	J C U	2.3	4.3	21,134	—
ワコールホールディングス	33	33	53,526	—	三菱ケミカル HLDGS	403.1	395.1	427,300	—	新田ゼラチン	6.9	8.2	6,199	—
ホギメディカル	3.8	3.6	29,520	—	日本合成化学	15	—	—	—	デクセリアルズ	17.8	16	23,664	—
T S Iホールディングス	27.6	25.4	20,980	—	ダイセル	84.3	78.8	108,901	—	アース製薬	4.5	4.3	22,059	—
三陽商会	37	4.4	7,233	—	住友ベークライト	56	51	42,585	—	イハラケミカル	10.3	—	—	—
オンワードホールディングス	36	37	30,858	—	積水化学	136	129.3	284,330	—	北興化学	—	12.9	8,991	—
ゴールドウイン	2.8	2.6	19,760	—	日本ゼオン	51	50	72,500	—	大成ラミック	2.8	3.3	9,784	—
デサント	14.4	13.5	19,683	—	アイカ工業	17.6	18.2	67,067	—	クマイ化学	13.5	26.3	20,540	—
パルプ・紙 (0.2%)					宇部興産	327	295	98,235	—	日本農薬	15.1	15.6	10,155	—
特種東海製紙	38	3.1	14,198	—	積水樹脂	8.7	8.4	17,774	—	アキレス	63	5.1	11,541	—
王子ホールディングス	229	223	132,685	—	タキロンシーアイ	17	13	8,853	—	有沢製作所	11.1	12.7	13,106	—
日本製紙	31.2	25.6	53,196	—	旭有機材	32	31	9,083	—	日東電工	47.4	42.2	412,083	—
三菱製紙	111	11.2	8,366	—	日立化成	29.5	32.4	104,976	—	レック	—	4.5	13,342	—
北越紀州製紙	39.5	32.9	22,766	—	ニチパン	9	7	8,057	—	きもと	—	22.5	5,512	—
中越パルプ	30	26	5,902	—	リケンテクノス	13.5	13.6	8,880	—	藤森工業	5.5	4.9	18,571	—
巴川製紙	—	24	8,280	—	大倉工業	20	18	14,490	—	前澤化成工業	7.4	8.7	10,848	—
大王製紙	27.2	23	30,590	—	積水化成成品	18	8.9	11,409	—	ジェイエスピー	4.3	3	10,230	—
レンゴー	53	53.4	34,176	—	群栄化学	21	1.9	7,049	—	エフビコ	5.3	5.3	29,733	—
トーモク	24	19	7,448	—	タイガース ポリマー	—	6.2	4,885	—	天馬	5.4	3.7	8,487	—
ザ・バック	4.7	4.4	17,644	—	ダイキョーニシカワ	8.6	10.4	18,075	—	信越ポリマー	14.3	12.5	12,787	—
化学 (7.2%)					日本化薬	40	37	67,192	—	東リ	22	23.6	9,510	—
クラレ	94.8	98	208,544	—	カーリットホールディングス	10.2	16.1	11,930	—	ニフコ	11.6	10.1	69,488	—
旭化成	378	365	510,635	—	日本精化	7.9	8.3	7,851	—	日本バルカー	33	5.4	15,530	—
共和レザー	6.3	6.2	5,834	—	扶桑化学工業	—	4.8	16,944	—	ユニ・チャーム	124	118.7	308,857	—
昭和電工	40.8	39.8	133,927	—	A D E K A	27.8	22.8	44,642	—	医薬品 (4.5%)				
住友化学	445	430	304,010	—	日油	46	45	73,215	—	協和発酵キリン	73	70	130,480	—
住友精化	14	2.6	13,598	—	花王	155	137.6	941,734	—	武田薬品	241.9	219.7	1,360,162	—
日産化学	36.7	31.7	129,336	—	第一工業製薬	25	19	12,958	—	アステラス製薬	662.5	572.7	839,578	—
ラサ工業	41	57	12,027	—	三洋化成	20	3.2	20,384	—	大日本住友製薬	43.8	40.3	59,603	—
クレハ	45	4.3	24,725	—	大日本塗料	43	37	12,802	—	塩野義製薬	89.3	74.3	442,753	—
テイカ	14	11	11,308	—	日本ペイント HOLD	47.2	45.7	178,687	—	田辺三菱製薬	69.8	68.5	185,429	—
石原産業	120	11.6	17,980	—	関西ペイント	67.9	61.6	173,835	—	あすか製薬	9.4	6.7	11,591	—
日東エフシー	5.8	6	5,268	—	中国塗料	18	15.8	14,694	—	日本新薬	14.1	13.7	108,915	—
日本曹達	41	35	23,520	—	日本特殊塗料	6.2	5	9,620	—	中外製薬	61.4	59	274,940	—
東ソー	164	171	221,616	—	藤倉化成	14.5	9.8	6,458	—	科研製薬	10.5	10.9	63,547	—
トクヤマ	110	94	48,786	—	太陽ホールディングス	4.6	4.8	25,824	—	エーザイ	75.3	72.2	423,741	—
セントラル硝子	66	57	28,842	—	D I C	23.7	23	92,000	—	ロート製薬	30.3	28.9	76,007	—
東亞合成	37.2	33.2	48,339	—	サカタインクス	12.9	12.4	25,320	—	小野薬品	140	133.4	324,162	—
大阪ソーダ	28	25	14,325	—	東洋インキSCホールディング	57	47	29,986	—	久光製薬	18.9	16.4	87,740	—
関東電化	16	12.6	14,338	—	T & K T O K A	6.2	5.3	6,794	—	田村製薬	4.3	3.6	30,240	—
デンカ	127	111	81,363	—	富士フイルム HLDGS	139	114.8	503,168	—	参天製薬	111.6	105.8	190,757	—
信越化学	109	105.3	1,069,848	—	資生堂	116.9	105.1	482,409	—	扶桑薬品	28	2.7	7,487	—
日本カーバイド	85	36	8,604	—	ライオン	71	78.9	171,055	—	日本ケミファ	13	1.6	8,144	—
堺化学	28	20	11,020	—	高砂香料	4.3	4	15,360	—	ツムラ	19.3	20.1	80,701	—
エア・ウォーター	49	46.8	96,408	—	マンダム	5.8	5.8	36,888	—	日医工	14.6	13.6	23,052	—
大陽日酸	45.9	44.5	57,138	—	ミルボン	3.9	4.1	27,470	—	キッセイ薬品工業	10.1	10.2	29,314	—
日本化学工業	32	31	8,308	—	ファンケル	14.2	13.2	32,089	—	生化学工業	12.4	10.9	21,353	—
日本パーカラライジング	29.3	29.6	51,800	—	コーセー	9.9	9.6	131,232	—	栄研化学	6	5.2	21,580	—
高圧ガス	12	9.2	7,764	—	シーズ・ホールディングス	8.4	8.1	31,185	—	日水製薬	—	4.2	5,959	—
四国化成	10	9	14,715	—	ポーラ・オルビス HD	6.2	24.8	86,924	—	鳥居薬品	4.7	3.9	11,544	—
戸田工業	—	17	8,891	—	ノエビアホールディングス	4.1	4.2	26,838	—	J C Rファーマ	5.4	4.8	14,688	—
ステラ ケミファ	4.4	3.1	15,655	—	コニシ	10.6	9.5	18,971	—	東和薬品	3	2.8	14,672	—
保土谷化学	34	2.3	19,849	—	長谷川香料	7.9	7.3	15,789	—	富士製薬工業	2.7	2.7	10,597	—
日本触媒	8.8	9.1	74,529	—										

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	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
沢井製薬	10.4	9.6	59,328	9.6	中山製鋼所	—	6.4	4,742	6.4	ノーリツ	11.8	11.9	23,383	23,383
ゼリア新薬工業	13.1	12.5	25,287	12.5	合同製鐵	41	3.9	8,303	3.9	長府製作所	5.9	5.7	15,390	15,390
第一三共	205.9	171.8	448,398	171.8	J F Eホールディングス	164.7	159.8	357,232	159.8	リンナイ	11.2	10	97,000	97,000
キョーリン製薬HD	16.1	13.6	30,504	13.6	日新製鋼	27.3	18.2	25,862	18.2	岡部	13.7	11.6	11,901	11,901
大幸薬品	4.6	4.5	10,242	4.5	東京製鐵	33.8	31.7	31,002	31.7	ジーテクト	7.3	6.1	13,548	13,548
ダイト	3.9	3.9	11,220	3.9	共英製鋼	7.1	6.6	11,081	6.6	東ブレ	12.2	10.9	36,460	36,460
大塚ホールディングス	131.7	116.3	509,161	116.3	大和工業	13.3	11.3	35,990	11.3	高周波熱練	12.8	11.2	12,544	12,544
大正製薬HD	14.5	12.1	105,149	12.1	東京製鋼	24	18	7,830	18	東京製鋼	49	4.8	7,987	7,987
ペプチドリーム	10.3	22.5	79,312	22.5	大阪製鐵	4.2	3.6	8,985	3.6	パイオラックス	3.3	9.5	27,502	27,502
石油・石炭製品 (0.6%)					淀川製鋼所	9.3	7.6	23,446	7.6	日本発条	53.3	52.9	62,686	62,686
日本コークス工業	64.2	65.3	7,313	65.3	東洋鋼鉄	17.3	16	8,720	16	三益半導体	5.5	5.8	10,393	10,393
昭和シエル石油	57.8	51.5	62,881	51.5	丸一鋼管	20.1	18.7	61,616	18.7	機械 (5.4%)				
ニチレキ	9	9.2	12,594	9.2	大同特殊鋼	101	99	64,845	99	日本製鋼所	102	19	49,685	49,685
東燃ゼネラル石油	90	—	—	—	日本高周波	64	64	7,360	64	三浦工業	27.2	23.9	62,665	62,665
ユシロ化学	4.8	4.7	7,675	4.7	日本冶金工	72.8	56.8	12,836	56.8	タクマ	23	19.7	26,831	26,831
ビービー・カストロール	4.3	—	—	—	山陽特殊製鋼	38	36	20,700	36	ツガミ	20	18	18,324	18,324
富士石油	19.5	18.9	7,938	18.9	愛知製鋼	38	3	13,290	3	オークマ	40	38	42,788	42,788
MORESCO	—	4.2	9,042	4.2	日立金属	68.7	59.8	92,570	59.8	東芝機械	34	31	18,724	18,724
出光興産	31.2	36.5	104,937	36.5	大平洋金属	48	43	13,416	43	アマダホールディングス	85.8	77.2	95,882	95,882
JXTGホールディングス	712.9	889.3	503,077	889.3	新日本電工	40.4	37.5	17,700	37.5	アイダエンジニア	16.9	16.1	20,930	20,930
コスモエネルギーHLDGS	18.6	17.7	42,462	17.7	栗本鉄工所	35	3.1	7,232	3.1	滝澤鉄工所	81	56	11,256	11,256
ゴム製品 (1.0%)					日本鉄鉄管	—	25	4,525	25	富士機械製造	17.9	18.5	38,535	38,535
横浜ゴム	36.4	32.5	72,962	32.5	三菱製鋼	47	46	13,386	46	牧野フライス	31	30	28,950	28,950
東洋ゴム	27.5	33.8	80,883	33.8	シンニタン	—	8.8	6,520	8.8	オースジー	27.4	24.4	60,878	60,878
ブリヂストン	206.1	197.7	993,442	197.7	非鉄金属 (1.0%)					旭ダイヤモンド	17.2	16.7	18,904	18,904
住友ゴム	55.8	54.4	107,984	54.4	大紀アルミニウム	—	15	12,270	15	DMG森精機	33.9	30.9	59,946	59,946
藤倉ゴム	—	10.7	10,079	10.7	日本軽金属HD	145.9	146.2	48,392	146.2	ソディック	15.3	16.6	23,389	23,389
オカモト	20	19	22,287	19	三井金属	161	163	97,148	163	ディスコ	7.7	7	162,400	162,400
ニッタ	5.9	5	20,175	5	東邦亜鉛	43	37	18,130	37	日東工器	4.1	3.4	9,302	9,302
住友理工	13.3	9.4	10,321	9.4	三菱マテリアル	378	36.4	144,508	36.4	OKK	42	59	7,788	7,788
ミツ星ベルト	16	14	18,830	14	住友鉱山	167	152	297,312	152	島精機製作所	8.8	8	43,200	43,200
バンドー化学	25	9.2	11,021	9.2	DOWAホールディングス	80	64	52,672	64	NCホールディングス	3.2	—	—	—
ガラス・土石製品 (1.0%)					古河機金	103	92	17,940	92	フリーユ	—	4.5	4,882	4,882
日東紡績	43	48	31,344	48	大阪チタニウム	6.8	7.4	11,840	7.4	日阪製作所	9.4	9.3	9,151	9,151
旭硝子	301	57.1	237,821	57.1	東邦チタニウム	11.9	11.5	9,338	11.5	やまごこ	12.1	11.3	16,249	16,249
日本板硝子	315	25.9	22,015	25.9	UACJ	88	83	26,809	83	ペガサスミシン製造	—	9.6	7,238	7,238
日本山村硝子	30	41	8,118	41	古河電工	194	19.9	125,171	19.9	ナプテスコ	31.2	30	129,000	129,000
日本電気硝子	123	24.3	103,275	24.3	住友電工	241.1	219.6	389,790	219.6	三井海洋開発	7.4	6.1	15,408	15,408
住友大阪セメント	123	109	54,500	109	フジクラ	84	78	72,150	78	レオン自動機	—	6.9	9,784	9,784
太平洋セメント	379	356	156,284	356	昭和電線HLDGS	98	96	10,080	96	S MC	18.2	17.6	705,760	705,760
日本ヒューム	8.1	10.3	6,993	10.3	タツタ電線	16.7	15	12,855	15	新川	11.5	8.2	6,314	6,314
日本コンクリート	23.9	17.5	7,752	17.5	リョービ	39	34	20,468	34	ホンカワミクロン	12	2.6	15,912	15,912
アジアパイルHD	16.6	10.8	6,382	10.8	アールステイ	9.4	8	7,312	8	ユニオンツール	2.9	2.9	10,353	10,353
東海カーボン	54	53	47,700	53	アサヒHD	9.4	8.7	20,166	8.7	オイルス工業	7.7	6.6	13,477	13,477
日本カーボン	36	3.3	13,860	3.3	金属製品 (0.7%)					日精エーエスピー	2.8	—	—	—
東洋炭素	4.1	4	10,744	4	稲葉製作所	4.5	4.3	6,032	4.3	サトーホールディングス	8.4	7.7	20,674	20,674
ノリタケ	37	3.6	20,088	3.6	宮地エンジニアリングG	56	24	7,488	24	日精樹脂工業	7.2	6.5	9,288	9,288
TOTO	44.7	42.9	189,403	42.9	トーカロ	5.3	4.3	18,619	4.3	小松製作所	299.1	270.6	857,260	857,260
日本碍子	77	73.1	155,264	73.1	SUMCO	48.8	52	88,816	52	住友重機械	176	170	151,810	151,810
日本特殊陶業	51.9	50.2	111,695	50.2	川田テクノロジー	1.5	1.4	8,470	1.4	日立建機	26.7	26.2	84,757	84,757
MARUWA	2.8	2.4	15,216	2.4	東洋製罐ブルーパHD	41.1	39.3	75,023	39.3	巴工業	3.8	4.8	9,211	9,211
品川リフラクトリーズ	27	16	5,904	16	ホッカンホールディングス	20	18	7,596	18	井関農機	66	5.5	13,431	13,431
黒崎播磨	—	16	8,656	16	横河ブリッジHLDGS	12.4	10.5	22,123	10.5	TOWA	8	5.6	9,878	9,878
フジインコーポレーテッド	5.7	5.4	14,526	5.4	駒井ハルテック	—	2.5	5,847	2.5	丸山製作所	27	4.6	8,303	8,303
ニチアス	31	32	42,560	32	三和ホールディングス	61.4	57.5	73,427	57.5	北川鉄工所	47	3.4	8,962	8,962
ニチハ	8.9	8.4	33,768	8.4	文化シャッター	18.2	15.9	14,310	15.9	ローツェ	—	3.3	7,758	7,758
鉄鋼 (1.3%)					三協立山	8.3	8.4	13,003	8.4	クボタ	293.8	301.6	607,422	607,422
新日鐵住金	274.3	263.1	713,527	263.1	アルインコ	6.8	6.4	8,230	6.4	三菱化工機	34	36	9,432	9,432
神戸製鋼所	1,107	101.1	135,777	101.1	LIXILグループ	83.2	82	250,510	82	月島機械	11.8	10.8	15,249	15,249

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
帝国電機製作所	8	6.6	7,840		三菱重工業	1,032	932	407,004		日立国際電気	14	14.7	43,717	
新東工業	14.6	14.2	17,522		I H I	446	432	166,320		ソニー	412.5	395.2	1,696,988	
渋谷工業	5.5	5.3	19,106		スター精密	—	10.1	19,200		T D K	34.9	31.1	233,872	
アイチ コーポレーション	10	9.7	7,430		電気機器 (13.6%)					帝国通信工業	46	30	6,900	
小森コーポレーション	15.2	14.3	19,962		日清紡ホールディングス	30.2	28.1	37,288		ミツミ電機	24.9	—	—	
鶴見製作所	5.1	4.9	10,113		イビデン	36.1	39.1	70,966		タムラ製作所	27	25	15,800	
住友精密	21	19	6,669		コニカミノルタ	144.5	129.2	120,156		アルプス電気	50.7	51.8	157,213	
荏原製作所	135	26.1	95,395		ブラザー工業	73.9	68.8	181,219		パイオニア	97.4	83.3	17,159	
西島製作所	7.7	6.4	7,616		ミネベアミツミ	94	103.3	196,166		日本電波工業	8.1	7.4	6,275	
北越工業	14.3	10	10,850		日立	1,482	1,342	1,064,340		日本トリム	1.9	1.4	6,531	
ダイキン工業	85	76.3	863,334		東芝	1,240	—	—		ローランドディー・ジー	3.6	3.5	9,709	
オルガノ	14	16	9,440		三菱電機	619	595	1,044,225		フオスター電機	7.7	6.9	16,070	
トーヨーカネツ	42	31	12,090		富士電機	175	167	104,876		クラリオン	34	31	13,578	
栗田工業	35.2	31.3	101,725		東洋電機製造	38	3.8	8,987		S M K	22	17	8,330	
椿本チエイン	34	31	27,776		安川電機	72.2	65.2	235,372		ヨコオ	8.1	6.3	9,128	
アネスト岩田	11.6	10.8	11,383		シンフォニアテクノロジー	47	42	21,294		ホシデン	19.6	17.2	31,390	
ダイフク	31.2	28.3	157,914		明電舎	56	51	20,553		ヒロセ電機	9.2	9	144,270	
加藤製作所	21	3.6	11,952		山洋電気	17	16	21,536		日本航空電子	17	16	29,168	
油研工業	54	36	9,180		デンヨー	6.2	5.6	11,396		T O A	7.9	7	8,470	
タダノ	28	29.8	39,783		東芝テック	43	35	21,875		日立マクセル	9.8	8.5	21,573	
フジテック	17	16.2	25,498		芝浦メカトロニクス	—	19	6,669		古野電気	10.1	8.8	6,107	
C K D	17.3	17.4	37,879		マブチモーター	16.6	15.4	84,700		ユニデンホールディングス	94	30	8,610	
キトー	9.3	8.1	10,440		日本電産	70.8	72.6	997,524		アルパイン	14.4	14.1	29,328	
平和	18	17.1	36,884		東光高岳	3.4	3.8	7,641		スミダコーポレーション	—	6.4	13,497	
理想科学工業	6.7	5.5	11,313		ダブル・スコープ	5.6	8.4	20,437		アイコム	4.2	3.5	9,439	
S A N K Y O	15.3	14.3	50,121		ダイヘン	35	32	31,552		リオン	—	3.4	7,803	
日本金銭機械	6.7	6.5	7,462		田淵電機	16.2	16	4,592		船井電機	6.7	6.3	5,392	
マースエンジニアリング	3.9	3.5	8,088		J V C ケンウッド	47.7	43.9	13,960		横河電機	58.7	60.3	113,786	
福島工業	4.2	3.7	15,614		第一精工	3.8	—	—		新元元工業	23	25	17,350	
ダイコク電機	3.4	3.3	5,517		日新電機	14.6	11.4	15,823		アズビル	18.2	16.6	80,842	
竹内製作所	12.2	10.7	24,545		大崎電気	12	12	10,032		日本光電工業	24.2	23	57,500	
アマノ	18	17.1	45,263		オムロン	65.7	59.4	348,678		共和電業	13.7	16.8	7,123	
J U K I	10.4	8.9	14,070		日東工業	9.6	7.6	15,329		堀場製作所	10.7	10.8	69,876	
サンデンホールディングス	37	41	17,630		I D E C	9.3	9.6	22,473		アドバンテス	40.3	38.6	81,716	
蛇の目マシン	12	7.5	5,737		シーエス・ユアサ コーポ	114	106	61,692		アイベック	7.1	5.6	12,454	
マックス	10	10	15,400		サクサホールディングス	—	28	5,964		パナソニックデバイス	8.3	—	—	
グローリー	19.7	17.1	68,058		メルコホールディングス	4.2	3.3	12,160		キーエンス	13.3	25.4	1,524,000	
新晃工業	5.3	6.2	10,967		日本電気	797	762	227,838		日置電機	3.8	3.2	7,568	
大和冷機工業	10.8	10.2	12,586		富士通	560	541	457,740		シスメックス	45.6	43.5	310,155	
セガサールホールディングス	60.9	55.3	83,337		沖電気	260	23.9	35,945		日本マイクログロニクス	—	10.7	11,074	
日本ビストンリング	7.5	4	9,464		電気興業	19	17	9,860		メガチップス	7.7	5.6	21,084	
リケン	31	2.8	15,652		サンケン電気	36	34	19,788		OBARA GROUP	3.9	3.5	21,245	
T P R	7.5	6.4	22,976		アイホン	4.1	4.2	7,614		コーセル	9.4	8.6	12,736	
ツバキ・ナカシマ	—	6.3	16,184		ルネサスエレクトロニクス	33	31	39,990		イリソ電子工業	—	4.8	29,088	
ホシザキ	12.9	17.7	179,478		セイコーエプソン	86.2	83.7	236,285		オプテックスグループ	4.7	4.8	20,568	
大豊工業	6	5.2	8,803		ワコム	48.4	44.7	23,288		千代田インテグレ	3.6	2.9	7,342	
日本精工	118.7	115.6	169,007		アルバック	10.9	9.7	64,699		レーザータック	7.9	13.4	30,324	
N T N	145	129	60,630		アクセル	4.9	4.9	3,753		スタンレー電気	41.2	39.7	153,639	
ジェイテクト	59.8	57.6	88,185		E I Z O	6.1	5.8	26,129		岩崎電気	64	33	6,534	
不二越	54	53	33,284		ジャパンディスプレイ	110.1	108.2	21,423		ウシオ電機	35.2	32.7	49,213	
日本トムソン	22	20.1	12,743		日本信号	16.6	15.4	18,972		日本セラミック	3.9	6.2	19,127	
T H K	37.9	39.6	153,450		京三製作所	19	20	11,200		遠藤照明	—	4.2	5,812	
ユーシン精機	3.1	3.3	10,048		能美防災	7.1	6.5	11,030		日本デジタル研究所	6	—	—	
イーグル工業	7.7	6.3	12,996		ホーチキ	5.6	5.1	10,801		古河電池	—	8	9,016	
日本ビラー工業	7.5	7	11,389		エレコム	5.9	5.2	11,674		山一電機	11.6	6.3	12,461	
キッツ	29.2	28.8	25,574		日本無線	21	3.5	5,848		図研	8.9	5.6	9,329	
日立工機	7.2	—	—		パナソニック	666.3	642.1	1,060,428		日本電子	27	21	11,424	
マキタ	37.5	73.1	338,087		アンリツ	34.6	42.1	37,426		カシオ	59.5	44.5	70,176	
日立造船	46.7	42.6	24,537		富士通ゼネラル	18	19.5	44,362		ファナック	59	56.7	1,290,208	

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	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
日本シイエムケイ	—	13.5	13.5	14,418	ケーヒン	13.2	11.6	21,274	21,274	タカラトミー	20.1	22.5	32,557	32,557
エンプラス	3.2	2.6	2.6	12,272	河西工業	8.3	8.5	14,382	14,382	大建工業	28	4.6	12,622	12,622
ローム	28.2	27.2	27.2	255,680	アイシン精機	59	51.4	288,354	288,354	凸版印刷	160	153	170,442	170,442
浜松ホトニクス	44.8	39.8	39.8	142,882	富士機工	10.3	—	—	—	大日本印刷	168	154	204,050	204,050
三井ハイテック	11.1	8.6	8.6	22,050	マツダ	182.9	175.6	291,320	291,320	図書印刷	15	—	—	—
新光電気工業	22.8	22.4	22.4	16,979	今仙電機製作所	7.4	8.1	10,432	10,432	共同印刷	26	19	7,068	7,068
京セラ	95	91.3	91.3	637,547	本田技研	523.6	502	1,653,588	1,653,588	日本写真印刷	10.3	10.1	29,421	29,421
太陽誘電	29.2	27	27	47,034	スズキ	107.9	111.3	682,046	682,046	光村印刷	—	29	7,134	7,134
村田製作所	61.8	58.7	58.7	1,009,933	SUBARU	184.8	173.8	691,724	691,724	宝印刷	7.8	5.7	9,399	9,399
ユーシン	15.2	13.5	13.5	10,854	ヤマハ発動機	81.2	79.2	259,380	259,380	アシックス	54.2	55.1	92,512	92,512
双葉電子工業	10.3	8.4	8.4	17,833	ショーワ	15.9	15.9	20,367	20,367	ツツミ	3.5	2	3,792	3,792
北陸電気工業	86	45	45	7,110	T B K	25.4	20	9,980	9,980	小松ウオール工業	2.6	—	—	—
ニチコン	19.3	18.6	18.6	24,700	エクセディ	7.2	7.6	25,384	25,384	ヤマハ	42.8	37.8	147,798	147,798
日本ケミコン	55	51	51	20,094	豊田合成	19	17.1	46,135	46,135	河合楽器	3	3.4	7,599	7,599
K O A	9.1	8.9	8.9	18,574	愛三工業	11.2	10	10,160	10,160	クリナップ	9.1	7.1	6,404	6,404
市光工業	—	15	15	10,830	ヨロズ	5.8	5.2	11,897	11,897	ピジヨン	33.2	34	137,190	137,190
小糸製作所	34.7	33.6	33.6	244,608	エフ・シー・シー	9.8	9.2	23,036	23,036	キングジム	8.5	8.2	8,306	8,306
ミツバ	10.3	10.6	10.6	17,808	シマノ	23.6	22.6	336,062	336,062	リンテック	12.5	11.9	36,652	36,652
スター精密	11.9	—	—	—	テイ・エス テック	13.4	12.5	45,187	45,187	イトーキ	13.8	13.5	11,515	11,515
SCREEN ホールディングス	60	11.5	11.5	87,400	ジャムコ	4.2	3.5	8,823	8,823	任天堂	36.1	34.5	1,412,775	1,412,775
キャノン電子	6	6.1	6.1	13,914	精密機器 (1.6%)					三菱鉛筆	4.6	9.6	27,254	27,254
キャノン	311	299.5	299.5	1,149,181	テルモ	89.9	85.3	385,982	385,982	タカラスタンダード	23	10.6	20,892	20,892
リコー	187.3	166.8	166.8	183,480	日機装	22.4	20	20,560	20,560	コクヨ	30.2	26.5	48,813	48,813
東京エレクトロン	47.9	37.5	37.5	646,125	島津製作所	74	71.9	162,134	162,134	ナカバヤシ	18	21	7,035	7,035
輸送用機器 (8.9%)					J M S	20	22	7,436	7,436	グローブライド	3.7	3.6	6,994	6,994
トヨタ紡織	20.5	19.2	19.2	44,217	プイ・テクノロジー	1.7	1.2	23,568	23,568	岡村製作所	20.7	19.2	23,654	23,654
ユニプレス	12.4	10.5	10.5	30,492	東京計器	42	29	8,787	8,787	美津濃	32	30	19,530	19,530
豊田自動織機	51.9	51	51	320,280	東京精密	11.5	10.7	42,586	42,586	アデランス	13	—	—	—
モリタホールディングス	11	10.4	10.4	18,189	マニーマ	7.3	7	18,781	18,781	電気・ガス業 (1.7%)				
三桜工業	10.4	10.3	10.3	9,321	ニコン	107.5	96.1	181,629	181,629	東京電力HD	494.9	472.5	216,405	216,405
デンソー	143.1	137.6	137.6	757,075	トプコン	20.2	28.4	57,396	57,396	中部電力	179.1	184.3	265,115	265,115
東海理化電機	16.7	13.7	13.7	29,496	オリンパス	87.5	89	343,985	343,985	関西電力	241.3	229.4	353,390	353,390
三井造船	231	197	197	27,974	理研計器	5.9	5.9	12,620	12,620	中国電力	78.3	74.4	92,330	92,330
川崎重工業	449	429	429	157,443	タムロン	5.4	4.2	8,950	8,950	北陸電力	55.4	51.8	52,732	52,732
名村造船所	18.4	18.4	18.4	11,573	H O Y A	132.3	115	720,015	720,015	東北電力	145.3	139.9	209,010	209,010
日本車輛	30	26	26	7,774	ノーリツ鋼機	10.5	6.7	9,989	9,989	四国電力	51.6	50.5	71,508	71,508
近畿車輛	13	—	—	—	エー・アンド・デイ	—	13.1	7,047	7,047	九州電力	130.2	123.1	151,905	151,905
日産自動車	793.9	658.9	658.9	759,711	シチズン時計	70.2	58	45,182	45,182	北海道電力	55.2	51.5	42,951	42,951
いすゞ自動車	167.3	161.7	161.7	241,013	リズム時計	37	39	9,126	9,126	沖縄電力	9.6	9.8	24,049	24,049
トヨタ自動車	742.2	679.3	679.3	4,571,009	大研医器	6.7	7.1	5,530	5,530	電源開発	48.8	44.2	129,417	129,417
日野自動車	82.1	80.6	80.6	109,616	メニコン	4.1	3.9	17,160	17,160	イーレックス	—	8.2	8,601	8,601
三菱自動車工業	233.8	206	206	178,190	松風	4.4	4.4	5,759	5,759	東京瓦斯	649	602	345,849	345,849
エフテック	4.9	5	5	9,025	セイコーHD	38	38	18,962	18,962	大阪瓦斯	594	544	233,104	233,104
武蔵精密工業	6.5	6.9	6.9	23,356	ニプロ	43.1	38.6	56,742	56,742	東邦瓦斯	145	137	95,352	95,352
日産車体	24.9	23.9	23.9	30,137	その他製品 (2.2%)					北海道ガス	34	26	7,254	7,254
新明和工業	26	22.7	22.7	23,358	パラマウントベッドHD	6.3	5.2	25,662	25,662	広島ガス	23.3	20.6	7,292	7,292
極東開発工業	12.3	11.8	11.8	21,299	ニホンフラッシュ	—	4.5	7,272	7,272	西部瓦斯	67	58	15,892	15,892
日信工業	13.1	12	12	24,048	前田工業	8	7.7	14,067	14,067	静岡ガス	18.7	13.9	12,468	12,468
トピー工業	52	47	47	17,578	永大産業	14	15	8,160	8,160	メタウォーター	3.9	3.3	10,131	10,131
ティラド	35	25	25	11,500	アートネイチャー	7.1	8	5,704	5,704	陸運業 (4.0%)				
曙ブレーキ	43.2	29.2	29.2	10,453	ダンロップスポーツ	—	4.1	6,330	6,330	SBS ホールディングス	7.7	6.8	5,344	5,344
タチエス	9.9	9.8	9.8	19,903	バンダイナムコ HLDGS	59.6	61.9	225,625	225,625	東武鉄道	309	294	183,750	183,750
N O K	27.9	26.7	26.7	69,233	共立印刷	38.4	27.1	9,322	9,322	相鉄ホールディングス	98	85	47,005	47,005
フタバ産業	21.8	18.9	18.9	24,059	S H O E I	—	3.2	10,656	10,656	東京急行	339	149.6	240,108	240,108
K Y B	66	64	64	40,640	フランスベッド HLDGS	9.4	4.3	4,510	4,510	京浜急行	155	155	179,800	179,800
大同メタル工業	9.2	7.4	7.4	7,422	パイロットコーポレーション	10.3	9.7	50,343	50,343	小田急電鉄	186	88.6	189,692	189,692
プレス工業	32.9	30.1	30.1	18,902	萩原工業	—	2.6	9,308	9,308	京王電鉄	162	152	142,728	142,728
カルソニックカンセイ	45	—	—	—	トッパン・フォームズ	11	8.9	10,510	10,510	京成電鉄	87	41.5	128,857	128,857
太平洋工業	14	13.4	13.4	19,322	フジールインターナショナル	7.1	12.8	44,672	44,672	富士急行	17	16	19,520	19,520

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
新成電鉄	25	14	5,852		新日鉄住金 S O L	10.2	9.2	23,018		日本テレビ HDLS	51.9	49.5	94,693	
東日本旅客鉄道	106.6	108.3	1,104,118		ソフトフリエイト HD	—	5.3	7,923		テレビ朝日 HD	16	14.9	31,960	
西日本旅客鉄道	55.9	53.9	424,570		T I S	19.4	18.5	58,552		スカパー JSATHD	46.7	33.2	16,799	
東海旅客鉄道	52.1	46.4	901,784		電算システム	3.4	3.3	6,402		テレビ東京 HD	6.2	5.3	12,587	
西武ホールディングス	61.4	77.4	142,725		グリー	36.3	38.1	29,222		ワイヤレスゲート	—	4.7	6,387	
鴻池運輸	9.1	8.7	14,207		コーエーテックモ HD	14	13.1	29,697		コネクシオ	6.7	5.5	10,813	
西日本鉄道	76	61	33,184		三菱総合研究所	2.9	2.6	8,450		日本通信	46	56.9	7,852	
ハマキョウレックス	5.5	4.1	12,246		ファインデックス	—	5.6	4,692		日本電信電話	444	442.9	2,274,291	
サカイ引越センター	3	2.9	16,907		K L a b	11	11.1	19,425		K D D I	569.3	537.9	1,603,479	
近鉄グループ HDGS	577	547	233,022		ポルトゥウィン・ピットクル	9.1	5.8	8,943		光通信	6.8	6.7	91,790	
阪急阪神 HDGS	77.4	70	297,150		ネクソン	56.1	61.3	180,405		N T T ドコモ	429.5	405.7	1,048,125	
南海電鉄	130	116	65,192		アイスタイル	11	14.5	9,497		エムティーアイ	10.6	10.3	7,343	
京阪ホールディングス	128	123	82,902		エイチーム	4.4	5	15,325		GMO インターネット	22.2	21.9	32,850	
神戸電鉄	27	22	9,086		テクノスジャパン	—	6.1	6,453		カドカワ	18.3	16.3	21,907	
名古屋鉄道	209	199	98,903		コロプラ	16.4	17.9	22,786		学研ホールディングス	28	3.2	10,416	
山陽電鉄	27	22	12,848		ブロードリーフ	7.8	15.3	13,372		ゼンリン	8.4	8	27,200	
日本通運	221	205	151,905		ハーツユニテッドグループ	—	4.2	6,195		松竹	38	3.6	58,140	
ヤマトホールディングス	106	100.2	232,063		ティーガイア	6.2	5.7	11,998		東宝	40.9	36.1	141,873	
山九	76	74	66,970		豆蔵ホールディングス	—	7.2	8,085		東映	22	20	25,440	
丸全昭和運輸	24	21	10,815		デクマトリックス	—	4.6	7,134		N T T データ	36.4	170.3	204,360	
センコーグループ HDGS	27	26.5	21,306		ガンホー・オンライン・エンター	133.3	150.5	45,451		D T S	7.2	6.3	19,561	
トナミホールディングス	16	15	8,025		GMO ベイメントゲートウェイ	5.2	4.2	30,114		スクウェア・エニックス・HD	24.4	21.4	83,995	
ニッコンホールディングス	17.6	17.8	47,526		インターネットイニシアティブ	9.9	9.1	19,383		シーイーシー	5.9	4.4	11,215	
福山通運	34	30	20,460		さくらインターネット	—	6	5,214		カプコン	14.9	12.9	35,126	
セイノホールディングス	40	38.8	58,432		SRA ホールディングス	4.3	3.5	10,251		ジャストテック	10.7	5.8	7,731	
神奈川中央交通	13	8	5,864		朝日ネット	15	17.6	9,363		S C S K	14.2	15.5	71,920	
日立物流	12.6	11.3	28,272		コムチュア	—	1.7	9,860		アイネス	10.1	8.8	9,002	
丸和運輸機関	—	1.7	7,837		g u m i	8.1	7	7,637		T K C	5.8	5.2	17,160	
九州旅客鉄道	—	56.1	183,727		LINE	9.5	15.8	62,410		富士ソフト	9	7.5	24,525	
海運業 (0.2%)					野村総合研究所	40.5	41.5	174,922		N S D	13.1	11.7	23,844	
日本郵船	507	469	108,808		インテージホールディングス	4.3	3.9	11,122		コナミホールディングス	26.1	25.3	142,439	
商船三井	283	292	102,492		フジ・メディア・HD	58.7	56.4	88,604		福井コンピュータ HDLS	—	2.1	6,075	
川崎汽船	257	208	60,944		オービック	19.9	19.2	133,248		JBCC ホールディングス	10	11.5	12,305	
N S ユナイテッド海運	34	29	7,105		ジャストシステム	12.9	10.1	24,038		ミロク情報サービス	6.6	6.4	17,043	
飯野海運	34.9	29	14,703		TDC ソフトウェアエンジニア	—	5.4	6,199		ソフトバンクグループ	327	248.8	2,215,315	
空運業 (0.6%)					ヤフー	424.3	405.4	205,132		卸売業 (4.5%)				
日本航空	110.4	97.9	370,747		トレンドマイクロ	28.1	27	151,470		エレマテック	—	2.3	4,793	
ANA ホールディングス	1,072	1,039	436,068		日本オラクル	9.6	8.9	72,980		J A L U X	3	—	—	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)					フューチャー	10.2	10.3	9,723		あらた	3	3	14,325	
トランコム	2	1.8	10,926		CAC HOLDINGS	9.7	6	6,288		フィールズ	4.7	4.4	4,972	
日新	29	28	16,716		ソフトバンク・テクノ	—	4	7,204		双日	366.7	309.3	94,955	
三菱倉庫	39	34	47,464		オービックビジネス C	3.2	2.9	16,327		アルフレッサホールディングス	71.4	64.3	131,815	
三井倉庫 HOLD	39	38	12,920		伊藤忠テクノソリューションズ	13.3	12.9	52,374		横浜冷凍	15.7	12.8	13,964	
住友倉庫	35	35	26,040		アイティフォー	24	14.2	8,789		山下医科器械	—	4	6,828	
渋沢倉庫	22	30	11,910		大塚商会	15.8	16.8	118,944		アルコニック	5.3	8.6	15,729	
東陽倉庫	25	26.2	8,069		サイボウズ	27.5	14.2	7,284		神戸物産	4.3	3.9	20,007	
日本トランスシティ	18	20	9,360		ソフトラブレン	—	8	3,304		あいホールディングス	10.8	8.2	23,042	
安田倉庫	7.1	—	—		電通国際情報 S	4.5	4.2	10,571		ディー・ビーエックス	—	5.4	7,819	
東洋埠頭	79	50	9,700		デジタルガレージ	—	11.3	25,029		ダイワボウ HD	58	52	23,140	
上組	64	66	84,216		ウェザーニューズ	2.5	2.6	9,178		マクニカ・富士エレ HDGS	10.9	10.3	20,898	
キユーソー流通システム	2.9	2.1	6,373		C I J	14.1	16.4	10,381		パイタル K S K HD	11.1	9.5	8,939	
郵船ロジスティクス	6.7	4.7	4,728		WOWOW	3.5	3.4	12,648		UKC ホールディングス	4.3	4.6	8,891	
近鉄エクスプレス	11.1	10.2	18,023		ネットワンシステムズ	26.6	25.8	29,953		TOKAI ホールディングス	29.3	25.1	21,259	
東海運	—	11.5	4,726		アルゴグラフィックス	—	3.8	12,939		三洋貿易	5.3	4.7	12,328	
内外トランスライン	—	6.2	9,591		マーベラス	11.6	10.8	10,465		ウイン・パートナーズ	—	6.3	9,317	
情報・通信業 (7.7%)					エイベックス・グループ HD	11.2	10.5	15,246		シップヘルスケア HD	11.8	10.2	36,567	
NEC ネットエスアイ	7	5.8	15,602		日本ユニシス	16.8	15.7	26,909		コメダホールディングス	—	10.4	19,541	
システナ	7.4	5.3	15,004		兼松エレクトロニクス	5.2	3.9	12,811		小野建	6.5	5.5	10,466	
デジタルアーツ	4.2	2.9	13,441		東京放送 HD	33.7	36.6	76,567		佐鳥電機	14.2	8.5	8,279	

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	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
伯東	—	5.3	8,851	8,851	サンリオ	17.5	16.4	35,506	35,506	ウエルシアHD	5.1	15.3	69,079	69,079
コンドールテック	—	7.7	8,631	8,631	サンワテクノス	5.9	—	—	—	クリエイティブSDH	8.9	8.1	24,340	24,340
ナガイレーベン	9.3	7.4	22,126	22,126	リョーサン	9.1	7.3	34,419	34,419	丸善CHIHD	—	16.7	5,878	5,878
三菱食品	6.4	5.5	17,737	17,737	新光商事	7.7	6.9	13,061	13,061	チムニー	2	1.3	3,786	3,786
松田産業	5.9	4.6	7,507	7,507	トーホー	3.6	3.2	8,544	8,544	ジョイフル本田	9.3	9.2	26,946	26,946
第一興商	10.2	8.9	47,793	47,793	三信電気	9.6	6.9	11,447	11,447	鳥貴族	—	3	9,810	9,810
メディアバルHD	56.5	55.1	107,059	107,059	東陽テクニカ	10.4	7.4	7,696	7,696	すかいらーく	17.7	34	55,352	55,352
萩原電気	—	3.5	9,747	9,747	モスフードサービス	7.7	7.2	25,668	25,668	綿半ホールディングス	—	3.6	8,870	8,870
アズワン	4.8	4.2	26,838	26,838	加賀電子	6	5.4	17,226	17,226	ユニテッド・スーパーマート	19.4	18.9	20,393	20,393
シモジマ	6.3	4.9	5,507	5,507	PALTA C	9.4	9.3	40,176	40,176	ブックオフコーポレーション	—	11.7	9,418	9,418
ドウシシャ	7.4	6.8	16,388	16,388	ヤマタセ	77	5.8	10,788	10,788	あさひ	5.3	4.9	6,252	6,252
小津産業	—	4	8,480	8,480	丸紅建材リース	—	34	7,582	7,582	日本調剤	1.9	2.1	7,612	7,612
黒田電気	11.2	7.3	14,519	14,519	日鉄住金物産	47	4.7	29,140	29,140	コスモス薬品	2.9	2.8	73,332	73,332
丸文	11.8	5.8	4,959	4,959	トラスコ中山	6.9	11.7	31,812	31,812	一六堂	—	17.1	7,079	7,079
ハビネット	6.5	5.8	9,854	9,854	オートバックスセブン	21.5	18.9	35,664	35,664	セブン&アイ・HLDGS	241.4	231	1,018,017	1,018,017
日本ライフライン	—	6.7	38,056	38,056	加藤産業	8.2	8	26,480	26,480	薬王堂	—	3.6	10,699	10,699
エクセル	4.2	4.2	8,001	8,001	イノテック	19.1	9.9	9,355	9,355	クリエイト・レストランツ・ホール	16.8	17	20,281	20,281
マルカキカイ	—	4	7,308	7,308	イエローハット	5.8	5.2	16,224	16,224	ツルハホールディングス	13.5	11.2	151,872	151,872
IDOM	16.6	17	11,390	11,390	日伝	2.9	2.7	12,312	12,312	サンマルクホールディングス	4.8	3.6	11,916	11,916
進和	4.9	5.4	12,047	12,047	因幡電機産業	6.8	6.5	28,795	28,795	トリドールホールディングス	7.3	7.2	25,452	25,452
シークス	4	3.6	17,010	17,010	ミスミグループ本社	64	64.2	194,526	194,526	クスリのアオキ	5.5	—	—	—
伊藤忠	452.9	405	742,365	742,365	スズケン	25.8	25	98,875	98,875	ダイユー・リックHLDGS	—	9.4	8,074	8,074
丸紅	559.5	546.1	405,697	405,697	ジェコス	4.9	5.5	6,726	6,726	クスリのアオキHLDGS	—	4.6	31,326	31,326
高島	66	32	7,520	7,520	小売業 (4.6%)	—	—	—	—	メディカルシステムネットワーク	14.9	—	—	—
長瀬産業	26	30	54,690	54,690	ローソン	22	17.2	125,044	125,044	総合メディカル	3.1	3	15,960	15,960
蝶理	4.7	4.8	10,075	10,075	サンエー	4	4.2	21,000	21,000	ノジマ	—	9.2	18,924	18,924
豊田通商	62.1	61.9	226,554	226,554	カワチ薬品	4.9	4.6	12,420	12,420	カッパ・クリエイティブ	9.4	7.5	9,802	9,802
三共生興	13.2	—	—	—	エービーシー・マート	7.6	9.9	57,717	57,717	ライトオン	5.7	5.7	5,329	5,329
兼松	129	121	33,275	33,275	ハードオフコーポレーション	6.9	5.3	6,031	6,031	良品計画	6.7	7.4	250,860	250,860
三井物産	520.7	499	841,563	841,563	アスクル	7.2	6.1	20,740	20,740	アドヴァン	—	6.9	6,589	6,589
日本紙パルプ	28	27	12,933	12,933	ゲオホールディングス	11.2	8.8	13,569	13,569	アルビス	2.3	2.2	9,339	9,339
日立テクノロジーズ	19.5	19.3	78,358	78,358	アダストリア	10.9	8.8	21,260	21,260	コナカ	11	12	6,708	6,708
カメイ	8.5	7.6	13,087	13,087	くらコーポレーション	3.6	3.3	16,566	16,566	コーナン商事	8.9	7.6	15,716	15,716
東都水産	28	—	—	—	キャンドウ	5.6	4.5	7,875	7,875	ワタミ	9	7.2	11,217	11,217
OUGホールディングス	—	27	7,803	7,803	バルグループHLDGS	3.7	3.1	11,036	11,036	ドンキホーテホールディング	37.2	36	154,440	154,440
スターゼン	2.5	2.5	13,275	13,275	エディオン	24.8	21	22,218	22,218	西松屋チェーン	12	9.7	12,095	12,095
山善	23.4	20.6	24,369	24,369	サラーコーポレーション	—	11.3	10,045	10,045	ゼンショーホールディングス	29.4	29.2	60,414	60,414
住友商事	355.2	344.9	554,771	554,771	ワッツ	—	5.2	6,536	6,536	幸楽苑ホールディングス	5.6	6.9	12,075	12,075
内田洋行	19	3.2	11,056	11,056	ハローズ	—	2.1	5,063	5,063	サイゼリヤ	9.8	8.6	26,746	26,746
三菱商事	431.9	414.6	1,086,459	1,086,459	あみやき亭	1.5	1.8	8,559	8,559	V Tホールディングス	21.7	19.5	12,460	12,460
第一実業	18	17	10,455	10,455	ひらまつ	12.6	14.7	9,025	9,025	ポプラ	—	10.5	6,174	6,174
キャノンマーケティングJPN	16.3	16	41,600	41,600	ゲンキー	1.7	2.5	11,462	11,462	ユニテッドアローズ	8.3	7.6	31,160	31,160
西華産業	29	22	13,046	13,046	大黒天物産	—	1.6	8,416	8,416	ハイディ日高	5.6	6.5	22,457	22,457
菱洋エレクトロ	7.7	5.2	10,259	10,259	ハニースホールディングス	6.7	6.9	8,673	8,673	京都きもの友禅	8.5	11.3	10,576	10,576
ユアサ商事	6.1	5.6	21,476	21,476	アルペン	5.5	3.8	8,367	8,367	コロワイド	19.3	17.6	37,065	37,065
神鋼商事	54	2.6	10,153	10,153	クオール	6.8	6.9	13,268	13,268	壱番屋	5.4	3.9	18,778	18,778
阪和興業	59	56	42,952	42,952	ジーンズ	4.1	4	26,680	26,680	スギホールディングス	10.2	12.1	71,753	71,753
カナデン	10.1	8.9	10,475	10,475	ビックカメラ	32.6	31.7	41,241	41,241	スクロール	19.8	12.7	4,965	4,965
菱電商事	13	10	8,050	8,050	DCMホールディングス	28	32.8	33,587	33,587	ヨンドシーホールディングス	4.8	5.7	18,468	18,468
岩谷産業	67	59	39,353	39,353	Monotaro	21	20.1	70,249	70,249	ユニ・ファミリーマートHD	25.6006	24.4	139,812	139,812
すてきなスグループ	36	45	6,930	6,930	アークランドサービスHD	2.6	5.6	12,560	12,560	木曽路	7.9	6.7	18,773	18,773
三菱石油	15	15.1	18,935	18,935	J. フロントリテイリング	72.4	69.8	104,490	104,490	サトレストランジシステムズ	10.4	10.1	9,554	9,554
稲畑産業	15.2	12.7	18,669	18,669	ドトール・日レスHD	10.2	9.4	22,644	22,644	千趣会	14.2	13.6	9,180	9,180
ワキタ	12.8	12.8	16,960	16,960	マツモトキヨシHLDGS	11.9	10.5	82,530	82,530	ケーヨー	13.2	14.5	11,353	11,353
東邦ホールディングス	18.7	16.8	35,095	35,095	ブロンコビル	3.3	3.5	9,618	9,618	上新電機	15	14	25,620	25,620
サンゲツ	20	17.7	35,612	35,612	スタートトゥデイ	18	49.4	178,087	178,087	日本瓦斯	9	10.5	37,800	37,800
ミツウロコグループ	10.9	9.5	8,208	8,208	物語コーポレーション	1.9	2	14,360	14,360	ロイヤルホールディングス	10	9.6	27,014	27,014
シナモンホールディングス	16	2.7	6,145	6,145	ココカラファイン	6.1	5.8	36,772	36,772	いなげや	7.6	6.9	13,586	13,586
伊藤忠エネクス	15.2	10.2	11,801	11,801	三越伊勢丹HD	113.5	110.4	126,960	126,960	島忠	14.6	13.5	37,543	37,543

銘柄	期首株数	当期末株数	当期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	当期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	当期末評価額
千株	千株	千円	千株	千株	千円	千株	千円	千株	千株	千円	千円
チヨダ	6.8	6.3	17,696	北越銀行	64	6.4	16,115	トマト銀行	85	6.2	9,442
ライフコーポレーション	4.1	4.2	11,898	西日本シティ銀行	178	—	—	みなと銀行	57	5.4	10,006
リンガーハット	5.8	6.7	17,219	千葉銀行	218	213	162,093	京葉銀行	44	33	16,368
AOKI ホールディングス	13.4	9.4	13,460	常陽銀行	198	—	—	関西アーバン銀行	6.7	8.8	11,730
オークワ	10	9	10,701	群馬銀行	122	119.2	79,625	栃木銀行	33	31.5	14,616
コメリ	8.7	8.1	25,960	武蔵野銀行	8.9	8	25,760	北日本銀行	2.8	3.1	9,362
青山商事	10.9	11.2	44,520	千葉興業銀行	19	17.6	9,979	東和銀行	91	119	13,923
しまむら	6.7	6.4	86,720	筑波銀行	27.4	30.7	11,174	福島銀行	102	108	9,612
高島屋	84	91	94,913	七十七銀行	87	84	44,520	大東銀行	61	45	7,650
松屋	12.5	13.6	14,579	青森銀行	43	40	17,480	トモニホールディングス	45.2	44	21,120
エイチ・ツー・オーティリング	29.2	28.1	55,272	秋田銀行	40	32	11,136	フィデアホール	55.5	68.8	13,209
近鉄百貨店	27	1.5	5,580	山形銀行	34	27	14,418	池田泉州HD	53	55.2	23,349
パルコ	6.6	—	—	岩手銀行	4.1	2.8	12,250	証券・商品先物取引業 (1.0%)			
丸井グループ	70.6	58.8	95,667	東邦銀行	49	43	17,673	F P G	21.2	20.7	26,640
アクシアル リテイリング	4.8	4.4	19,888	東北銀行	89	73	10,950	SBI ホールディングス	68.8	62.5	100,000
イオン	238.5	226	370,301	みちのく銀行	30	41	7,790	ジャフコ	10	9.5	52,155
イズミ	11.2	10.3	61,697	ふくおかフィナンシャル G	246	220	107,360	大和証券 G 本社	527	497	315,147
東武ストア	1.7	—	—	静岡銀行	165	143	142,428	野村ホールディングス	1,092.9	1,128.3	712,747
平和堂	11.7	10.6	26,765	十六銀行	69	62	22,072	岡三証券グループ	42	44	27,544
フジ	6.8	5.9	16,927	スルガ銀行	56.6	56.4	131,637	丸三証券	19.2	17.4	16,512
ヤオコー	6.6	6	32,580	八十二銀行	97	103.5	69,862	東洋証券	35	32	8,384
ゼビオホールディングス	8	7	14,770	山梨中央銀行	34	33	15,147	東海東京 HD	64.7	57.5	36,857
ケーズホールディングス	23.8	22.8	55,084	大垣共立銀行	75	84	25,452	光世証券	68	39	6,474
アインホールディングス	7.1	7.4	59,718	福井銀行	51	51	14,790	水戸証券	27.5	28.5	9,490
元気寿司	—	3.2	8,105	北國銀行	59	55	25,850	いちよし証券	16.2	12.5	13,200
ヤマダ電機	170.9	186.5	111,527	清水銀行	2.7	3	10,095	松井証券	23.5	27.2	23,392
アークランドサカモト	10.7	9.7	15,529	滋賀銀行	49	43	25,714	マックス G	74.4	56.3	16,664
ニトリホールディングス	25.3	24	414,000	南都銀行	52	6.5	20,117	カブドットコム証券	55.8	37.9	12,507
吉野家ホールディングス	21.2	20.3	38,224	百五銀行	50	44	20,900	植東証券	9.9	8	12,136
松屋フーズ	3.6	3.1	13,407	京都銀行	107	99	107,613	岩井コスモホールディング	7.8	8	10,800
サガミチェーン	9.5	8.5	12,010	紀陽銀行	21.7	19.5	34,515	藍澤證券	14.1	14.8	11,440
関西スーパーマーケット	—	6.1	8,643	三重銀行	28	3.8	9,834	マネースクウェア HD	7.8	—	—
王将フードサービス	4.3	3.4	15,402	ほくほくフィナンシャル G	370	35.1	59,880	マネーパートナーズ GP	—	10	4,710
プレナス	6.7	6.5	15,892	広島銀行	165	160	70,240	保険業 (2.4%)			
ミニストップ	4.9	4.3	9,399	山陰合同銀行	34	30.6	28,488	かんぽ生命保険	24.4	20.1	47,978
アークス	10.7	9.5	23,854	中国銀行	37.8	37.5	55,650	SOMPO ホールディングス	126.9	115.2	521,740
パローホールディングス	12.4	11.2	26,936	鳥取銀行	34	6	10,266	アニコム ホールディングス	5.2	4.2	13,776
ベルク	3.1	2.8	15,960	伊予銀行	55.8	78.1	65,135	MS & AD	170.3	154.2	562,830
大庄	—	4.3	7,297	百十四銀行	60	52	19,448	S O N Y F H	56.5	53.1	94,624
ファーストリテイリング	9.7	9.3	305,040	四国銀行	46	45	14,895	第一生命 HLDGS	365.3	333.2	632,913
サンドラッグ	12.4	21.1	98,431	阿波銀行	44	45	31,860	東京海上 HD	231.8	221.9	1,004,097
サックスパーホールディング	7	6.9	9,163	大分銀行	33	29	13,282	T&D ホールディングス	207.8	200.8	314,754
ペルーナ	15.9	14.1	15,806	宮崎銀行	39	38	15,200	アドバンスクリエイト	—	3.5	6,807
銀行業 (7.5%)				佐賀銀行	38	32	8,672	その他金融業 (1.3%)			
じもとホールディングス	51.6	59.2	11,899	十八銀行	37	39	10,491	全国保証	15.2	16	72,320
足利ホールディングス	42.2	—	—	沖縄銀行	5.5	5.2	23,738	クレディセゾン	43.5	41.2	84,666
めぐきフィナンシャル G	—	266.8	109,654	琉球銀行	12.5	11.5	19,067	芙蓉総合リース	6.7	6.5	47,450
東京 TY フィナンシャル G	8.3	8.1	22,169	セブン銀行	208.7	208.5	86,319	興銀リース	11.1	9.9	28,759
九州フィナンシャル G	86	88.9	59,118	みずほフィナンシャル G	8,180.9	7,486.6	1,465,876	東京センチュリー	13.4	11	53,240
ゆうちょ銀行	150.5	155.4	215,850	高知銀行	107	85	10,710	日本証券金融	24.1	23.8	14,280
富山第一銀行	—	14.4	7,430	山口フィナンシャル G	51	49	62,867	アイフル	98.2	99.1	38,748
コンコルディア・フィナンシャル	393.2	357.4	199,464	長野銀行	33	4.6	8,891	ポケットカード	9.4	—	—
西日本フィナンシャル HD	—	35.8	41,778	名古屋銀行	48	4	17,260	リコリース	4.9	4.8	19,968
新生銀行	519	523	91,525	北洋銀行	82.5	84.8	29,086	イオンフィナンシャルサービス	37.4	35.5	83,744
あおぞら銀行	372	346	147,742	愛知銀行	2.1	2	13,100	アコム	122.6	116.7	50,997
三菱 UFJ フィナンシャル G	4,616.9	4,183.2	2,965,328	第二銀行	39	3.5	6,212	ジャックス	33	32	17,440
りそなホールディングス	673.8	647.2	357,836	中京銀行	27	2.2	5,192	オリコ	248.4	118	21,594
三井住友トラスト HD	1,195	114.9	456,727	大光銀行	28	30	7,200	日立キャピタル	13.9	12.9	34,043
三井住友フィナンシャル G	461.2	442.4	1,897,011	愛媛銀行	31	7.1	10,195	オリックス	408.8	390.2	707,042
第四銀行	66	63	33,201								

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	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
三菱UFJリソース	141.1	140	80,920		GCA	8.6	7.5	7,762		日本郵政	180.8	149.8	212,716	
日本取引所グループ	166.7	173.4	334,141		エス・エム・エス	8.6	8.8	32,252		ベルシステム24HLDGS	—	10.1	11,958	
イー・ギャランティ	3.1	2.7	8,451		パーソルホールディングス	43.6	46.1	111,008		リログループ	2.4	30.4	78,067	
NECキャピタルソリューション	3.4	3.5	7,336		リニカル	—	4.1	6,227		東祥	2.2	2.1	11,550	
不動産業 (2.3%)					クックパッド	14.5	17.9	13,872		エイチ・アイ・エス	10	8.7	30,711	
いちご	60.9	53.6	20,153		スタジオアリス	3.6	2.9	7,693		共立メンテナンス	4.7	9.5	30,732	
日本駐車場開発	78.1	80.7	13,315		シミックホールディングス	4.2	3.4	5,225		イチネンホールディングス	11.7	7.1	10,607	
ヒューリック	120	115.6	121,148		総合警備保障	20.7	21.6	111,024		建設技術研究所	5.7	7.2	7,430	
野村不動産 HLDGS	37	39.3	87,914		カカココム	44.5	42.3	57,654		東京テアトル	98	60	9,180	
三重交通グループHD	14.7	9.9	4,415		ルネサンス	—	5.2	9,235		タナベ経営	—	4.3	6,101	
サムティ	—	6.2	10,434		ディップ	7.6	8.4	21,420		ナガワ	—	1.1	4,532	
日本商業開発	—	4.7	8,272		オプトホールディング	—	6.7	8,361		よみうりランド	18	15	7,230	
プランスコーポレーション	2.3	9.7	14,928		新日本科学	—	8.6	4,609		東京都競馬	45	4.3	14,319	
ユニゾホールディングス	4.1	5.5	14,294		ツクイ	17	16.3	12,290		常盤興産	79	5.8	10,590	
日本管理センター	5.5	4.6	6,900		エムスリー	54.1	51.6	166,410		カナモト	8.6	8.4	29,106	
フージャースHD	—	10.9	12,524		ツカダ・グローバルHOLD	6.8	—	—		東京ドーム	26	22.6	22,758	
オープンハウス	8.9	9.4	33,229		アウトソーシング	3.3	3.4	24,446		西尾レントオール	5.1	4.9	18,571	
東急不動産HD	139.3	129.3	84,950		ウェルネット	6.3	5.7	6,555		トランス・コスモス	7.6	6.8	17,081	
飯田GHD	52.6	45.4	88,257		ディー・エヌ・エー	28.1	27	65,799		乃村工藝社	13.9	13.5	34,276	
パーク24	29	30.9	83,955		博報堂DY HLDGS	83.4	81.5	119,316		藤田観光	25	2.2	7,755	
パラカ	—	3.5	8,659		ぐるなび	7.5	8.7	14,276		KNT-CTホールディングス	37	40	8,760	
三井不動産	305	293.2	685,208		エスアールジータカミヤ	—	10.4	6,624		日本管財	6.2	5.2	10,550	
三菱地所	431	411.4	781,660		ジャパンベストレスクース	—	16.5	7,078		トコカイ	3.1	2.7	13,230	
平和不動産	12.2	11.3	22,046		ファンコミュニケーションズ	15.9	16.3	19,820		セコム	63.4	60.3	502,057	
東京建物	62.8	59	81,597		ティア	—	10.1	8,766		セントラル警備保障	—	3.5	7,301	
ダイビル	15.7	14.4	16,488		インフォマート	13	29.3	22,912		丹青社	13.6	12.1	17,024	
京阪神ビルディング	11.8	12.7	9,017		JPホールディングス	22.2	23.7	9,077		メイトック	7.8	6.9	37,812	
住友不動産	138	133	457,387		EPSホールディングス	7.7	8.3	17,488		アサツー ディ・ケイ	10.7	10	30,750	
大京	107	105	22,785		プレステージ・インター	6.7	13.2	14,995		応用地質	7.4	7	11,396	
テオオーシー	23	19.5	19,734		アミューズ	4.2	3.9	10,857		船井総研ホールディン	9.9	8.3	28,469	
東京楽天地	19	1.4	7,756		ドリームインキュベータ	3.6	2.7	5,861		学究社	—	5.1	7,797	
レオパレス21	67.8	68.7	55,303		クイック	—	5.1	9,373		ベネッセホールディングス	20	19.8	77,121	
スターツコーポレーション	6.9	7.8	22,113		ケネディクス	82.3	76.4	43,548		イオンディライト	6.2	6.5	26,520	
フジ住宅	12.2	10.5	8,557		電通	68.1	65.1	306,946		ニチエ学館	12	11.6	13,873	
空港施設	12.1	7.6	4,484		イオンファンタジー	3	2.1	7,948		ダイセキ	12.1	10.2	29,121	
住友不動産販売	4.6	—	—		シーティーエス	—	9.8	7,379						
ゴールドクレスト	4.9	5.4	13,732		みらかホールディングス	15.3	14.6	74,460						
日神不動産	—	11.1	8,047		アルプス技研	3.8	3.1	11,315						
タカラレーベン	27.1	25.2	13,255		オリエンタルランド	66.3	63.3	538,113						
サンヨーハウジング名古屋	5.9	8.2	8,593		ダスキン	17.3	14.4	44,460						
イオンモール	36	36	72,180		明光ネットワークジャパン	8.9	7.9	11,826						
ファースト住建	—	4	6,784		ファルコホールディングス	4.1	6.6	10,824						
トーセイ	11.1	10.1	9,393		ラウンドワン	20.8	19.5	25,213						
エヌ・ティ・ティ都市開発	34.4	34	36,686		リゾートトラスト	25.2	22.7	45,695						
サンフロンティア不動産	8.5	7.1	8,094		ピー・エム・エル	8	7.5	17,992						
エフ・ジェー・ネクスト	14.9	8.9	8,650		りらいあコミュニケーション	11	10.7	14,113						
グランディハウス	—	16	6,896		リソー教育	—	12.9	10,797						
日本空港ビルデング	18.2	17.7	67,083		ユー・エス・エス	73	70.8	158,592						
サービス業 (4.0%)					サイバーエージェント	16.2	36	120,600						
日本工営	23	4.5	16,065		楽天	310.8	276.3	345,375						
LIFULL	18.6	16.4	15,563		デー・オー・ダブリュー	—	8.9	7,342						
ジェイエイリクルートメント	—	4.9	8,187		セントラルススポーツ	3	3.2	13,072						
日本M&Aセンター	9.7	17.2	93,052		フルキャストホールディングス	8	6	11,598						
アコーディア・ゴルフ	16.7	—	—		テクノプロ・ホールディング	10.3	10	52,800						
タケエイ	9.3	6.7	7,952		ジャパンマテリアル	3.2	4.5	13,234						
トラスト・テック	—	3.8	11,856		ベクトル	8.4	6.2	9,486						
パソナグループ	7.4	5.8	6,832		アサンテ	—	4.2	7,854						
CDS	—	6.3	7,919		N・フィールド	—	4.5	7,402						
リンクアンドモチベーション	—	13	9,035		リクルートホールディングス	124.1	385.7	948,822						

(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

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

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

項 目	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	株 2, 246, 000 (392, 600)	株 — (—)

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

■投資信託財産の構成

2017年9月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	135, 585, 875	96. 2
コール・ローン等、その他	5, 343, 291	3. 8
投資信託財産総額	140, 929, 166	100. 0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年9月19日現在

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

* 期首における元本額は143,240,630,767円、当期中における追加設定元本額は
15,781,466,537円、同解除元本額は26,029,216,564円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、トピ
ックス・インデックスファンド4,876,025,306円、ダイワ・トピックス・インデッ
クスファンドV A12,004,610,396円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックス
インデックスファンドV A2 63,814,361円、ダイワ国内重視バランスファンド30
V A (一般投資家私募) 98,324,013円、ダイワ国内重視バランスファンド50V A
(一般投資家私募) 1,596,875,323円、ダイワ国際分散バランスファンド30V A
(一般投資家私募) 73,496,283円、ダイワ国際分散バランスファンド50V A (一
般投資家私募) 2,267,542,428円、D－I's T O P I X インデックス29,570,535
円、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド27,492,055円、D Cダイワ・
ターゲットイヤー2050 571,628円、iFree T O P I X インデックス219,320,903

円、iFree 8資産バランス560,747,176円、D Cダイワ日本株式インデックス
61,209,294,542円、ダイワ・ライフ・バランス30 2,305,738,742円、ダイワ・ライ
フ・バランス50 2,363,094,190円、ダイワ・ライフ・バランス70 2,234,782,816
円、年金ダイワ日本株式インデックス3,968,008,120円、D Cダイワ・ターゲッ
トイヤー2020 20,185,626円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 59,526,245円、
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 12,595,154円、ダイワ世界分散バランスファ
ンド15V A404,752円、ダイワ世界分散バランスファンド20V A400,556円、ダイ
ワ世界分散バランスファンド20V A (国内株式型) 753,865円、ダイワ世界分散バ
ランスファンド25V A11,529,912円、ダイワ世界分散バランスファンド30V A
47,889,757円、ダイワ世界分散バランスファンド30V A (国内株式型)
27,538,772円、ダイワ世界バランスファンド40V A532,798,059円、ダイワ世界バ
ランスファンド60V A191,358,243円、ダイワ・バランスファンド35V A
11,883,395,819円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50V A319,015,775円、
ダイワ・ワールド・バランスファンド75V A481,942,796円、ダイワ・バランス
ファンド25V A (適格機関投資家専用) 1,022,475,874円、ダイワ国内バランス
ファンド25V A (適格機関投資家専用) 148,071,718円、ダイワ国内バランスファ
ンド30V A (適格機関投資家専用) 256,045,701円、ダイワ・ノーロード T O P I X
ファンド58,249,473円、ダイワファンドラップ T O P I X インデックス
5,574,613,851円、ダイワ T O P I X インデックス (ダイワ S M A 専用)
4,252,692円、ダイワファンドラップオンライン T O P I X インデックス
963,778,473円、ダイワ・インデックスセレクト T O P I X1,204,591,549円、ダ
イワライフスタイル25 192,618,067円、ダイワライフスタイル50 643,116,079
円、ダイワライフスタイル75 521,030,501円、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) 14,915,392,614円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,279円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月21日 至2017年9月19日

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

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

ダイワ日経 2 2 5 インデックス (ダイワSMA専用)

運用報告書(全体版) 第 2 期

(決算日 2018年 6 月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果を日経平均株価（日経２２５）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ストックインデックス２２５・マザーファンドの受益証券	
	ストックインデックス２２５・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄	
マザーファンドの運用方法	投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。 （イ）上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないます。 （ロ）株式の組入比率は、高位を保ちます。		
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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

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、「ダイワ日経 2 2 5 インデックス（ダイワSMA専用）」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目 9 番 1 号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の 9：00～17：00）

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

<4661>

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			日 経 平 均 株 価		株 式 組入比率	株 式 先物比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6 月15日)	10, 201	70	2. 7	19, 831. 82	2. 0	98. 7	1. 8	1
2 期末 (2018年 6 月15日)	11, 850	90	17. 0	22, 851. 75	15. 2	99. 0	1. 7	27

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) 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 3) 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1）期末の基準価額は分配金込みです。

（注2）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークは日経平均株価です。

基準価額・騰落率

期首：10,201円

期末：11,850円（分配金90円）

騰落率：17.0%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%	円	%	%	%
(期首)2017年 6月15日	10,201	—	19,831.82	—	98.7	1.8
6月末	10,316	1.1	20,033.43	1.0	98.0	1.8
7月末	10,257	0.5	19,925.18	0.5	98.7	1.2
8月末	10,117	△ 0.8	19,646.24	△ 0.9	98.3	1.7
9月末	10,546	3.4	20,356.28	2.6	97.1	2.8
10月末	11,404	11.8	22,011.61	11.0	98.1	1.9
11月末	11,773	15.4	22,724.96	14.6	97.6	2.4
12月末	11,806	15.7	22,764.94	14.8	97.7	2.3
2018年 1月末	11,978	17.4	23,098.29	16.5	98.0	1.9
2月末	11,451	12.3	22,068.24	11.3	97.8	2.2
3月末	11,212	9.9	21,454.30	8.2	97.9	2.1
4月末	11,743	15.1	22,467.87	13.3	98.0	2.0
5月末	11,603	13.7	22,201.82	12.0	97.5	2.5
(期末)2018年 6月15日	11,940	17.0	22,851.75	15.2	99.0	1.7

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■国内株式市況

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

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■ストックインデックス225・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■当ファンド

「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れて運用を行ないました。なお、期末の実質株式組入比率（日経平均先物を含む。以下同じ。）は100.7%となっておりますが、翌営業日計上のマザー解約金額を考慮した実質組入比率は100%程度となっております。

■ストックインデックス225・マザーファンド

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

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

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

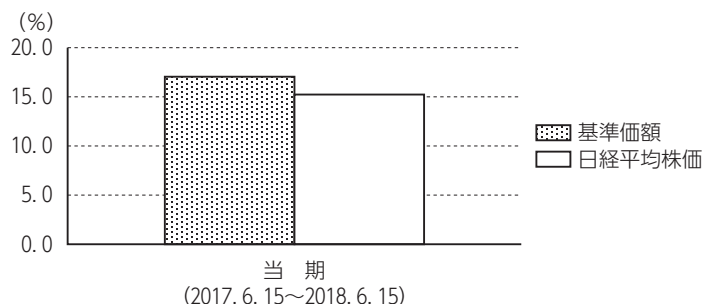
ベンチマークとの差異について

当期のベンチマークの騰落率は15.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は17.0%となりました。

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

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

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は90円といたしました。
収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年6月16日	～2018年6月15日
当期分配金（税込み）	(円)	90
対基準価額比率	(%)	0.75
当期の収益	(円)	80
当期の収益以外	(円)	10
翌期繰越分配対象額	(円)	1,850

- (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。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	81.37円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	1,850.29
(d) 分配準備積立金	8.73
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	1,940.40
(f) 分配金	90.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	1,850.40

(注) 下線を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■ストックインデックス225・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 6. 16～2018. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	37円	0. 335%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11, 185円です。
(投 信 会 社)	(23)	(0. 205)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(12)	(0. 108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0. 022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0. 002	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0. 000)	
(先 物)	(0)	(0. 002)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 007	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 007)	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	38	0. 343	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況
(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ストックインデックス225・マザーファンド	9,409	26,795	17	46

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合
(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

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

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。
(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況
当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況
(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等			売付額等		
区 分	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	27,758	3,563	12.8	29,609	3,164	10.7
株式先物取引	43,355	—	—	43,661	—	—
コール・ローン	527,988	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.0%
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等
(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

種 類	当 期		
	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
	百万円	百万円	百万円
株式	28	34	160

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券
(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

種 類	当 期
	ストックインデックス225・マザーファンド
	買 付 額
	百万円
株式	319

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率
当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■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

期首保有額	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

(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	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ストックインデックス225・マザーファンド	431	9,823	27,443

(注) 単位未満は切捨て。

投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ストックインデックス225・マザーファンド	27,443	99.8
コール・ローン等、その他	44	0.2
投資信託財産総額	27,487	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	27,487,572円
コール・ローン等	44,343
ストックインデックス225・マザーファンド（評価額）	27,443,029
未収入金	200
(B) 負債	247,003
未払収益分配金	206,883
未払信託報酬	39,560
その他未払費用	560
(C) 純資産総額（A－B）	27,240,569
元本	22,987,038
次期繰越損益金	4,253,531
(D) 受益権総口数	22,987,038口
1万口当り基準価額（C／D）	11,850円

*期首における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は21,987,038円、同解約元本額は0円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は11,850円です。

損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	△ 330,608円
売買益	154
売買損	△ 330,762
(B) 信託報酬等	△ 42,013
(C) 当期損益金（A＋B）	△ 372,621
(D) 前期繰越損益金	20,073
(E) 追加信託差損益金	4,812,962
（配当等相当額）	(443,249)
（売買損益相当額）	(4,369,713)
(F) 合計（C＋D＋E）	4,460,414
(G) 収益分配金	△ 206,883
次期繰越損益金（F＋G）	4,253,531
追加信託差損益金	4,789,975
（配当等相当額）	(420,262)
（売買損益相当額）	(4,369,713)
分配準備積立金	23,230
繰越損益金	△ 559,674

(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	187,053円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	4,253,288
(d) 分配準備積立金	20,073
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	4,460,414
(f) 分配金	206,883
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	4,253,531
(h) 受益権総口数	22,987,038口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	90円

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

【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、「ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）」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（ダイワ日経 2 2 5 インデックス（ダイワ S M A 専用））が投資対象としている「ストックインデックス 2 2 5 ・マザーファンド」の決算日（2017年 9 月19日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年 6 月15日）現在におけるストックインデックス 2 2 5 ・マザーファンドの組入資産の内容等を44～46 ページに併せて掲載いたしました。

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

(2017年 6 月16日から2018年 6 月15日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年 6 月15日現在におけるストックインデックス 2 2 5 ・マザーファンド（55, 624, 307千口）の内容です。

(1)国内株式

銘 柄	2018年 6 月15日現在		銘 柄	2018年 6 月15日現在		銘 柄	2018年 6 月15日現在	
	株 数	評 価 額		株 数	評 価 額		株 数	評 価 額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
水産・農林業 (0. 2%)			積水ハウス	248	478, 020	ニチレイ	124	359, 848
日本水産	248	135, 160	日揮	248	540, 888	日本たばこ産業	248	784, 920
マルハニチロ	24. 8	108, 004	千代田化工建	248	226, 920	繊維製品 (0. 3%)		
鉱業 (0. 1%)			食料品 (4. 8%)			東洋紡	24. 8	45, 706
国際石油開発帝石	99. 2	116, 510	日清製粉 G 本社	248	594, 208	ユニチカ	24. 8	16, 368
建設業 (2. 7%)			明治ホールディングス	49. 6	477, 648	帝人	49. 6	103, 465
コムシスホールディングス	248	732, 344	日本ハム	124	562, 340	東レ	248	220, 174
大成建設	49. 6	306, 032	サッポロホールディングス	49. 6	141, 856	パルプ・紙 (0. 1%)		
大林組	248	283, 216	アサヒグループホールディン	248	1, 414, 096	王子ホールディングス	248	177, 320
清水建設	248	275, 032	キリン H D	248	746, 232	日本製紙	24. 8	46, 301
長谷工コーポレーション	49. 6	79, 806	宝ホールディングス	248	362, 080	化学 (9. 0%)		
鹿島建設	248	222, 952	キッコーマン	248	1, 373, 920	クラレ		
大和ハウス	248	982, 824	味の素	248	535, 060	旭化成	248	409, 944
							248	358, 608

ストックインデックス 2 2 5 ・ マザーファンド

銘柄	2018年 6月15日現在		銘柄	2018年 6月15日現在		銘柄	2018年 6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
昭和電工	24.8	123,008	J F Eホールディングス	24.8	56,568	富士通	248	175,658
住友化学	248	159,712	日新製鋼	24.8	39,208	沖電気	24.8	31,074
日産化学	248	1,277,200	大平洋金属	24.8	98,952	セイコーエプソン	496	964,224
東ソー	124	224,068	非鉄金属 (1.2%)			パナソニック	248	388,368
トクヤマ	49.6	184,264	日本軽金属HD	248	62,992	ソニー	248	1,350,360
デンカ	49.6	192,696	三井金属	24.8	127,720	T D K	248	2,849,520
信越化学	248	2,586,640	東邦亜鉛	24.8	107,508	アルプス電気	248	694,896
三井化学	49.6	151,032	三菱マテリアル	24.8	77,996	パイオニア	248	39,928
三菱ケミカルHLDGS	124	120,304	住友鉱山	124	571,640	横河電機	248	497,984
宇部興産	24.8	76,508	DOWAホールディングス	49.6	180,792	アドバンテスト	496	1,151,712
日本化薬	248	297,104	古河機金	24.8	40,548	カシオ	248	422,344
花王	248	2,144,456	古河電工	24.8	100,192	ファナック	248	5,612,240
富士フイルムHLDGS	248	1,069,376	住友電工	248	419,740	京セラ	496	3,243,840
資生堂	248	2,230,264	フジクラ	248	187,488	太陽誘電	248	727,880
日東電工	248	2,159,088	金属製品 (0.3%)			SCREENホールディングス	49.6	427,552
医薬品 (7.7%)			S U M C O	24.8	58,255	キャノン	372	1,395,744
協和発酵キリン	248	584,536	東洋製罐グループHD	248	463,760	リコー	248	251,472
武田薬品	248	1,082,520	機械 (5.0%)			東京エレクトロン	248	4,731,840
アステラス製薬	1,240	2,192,320	日本製鋼所	49.6	152,272	輸送用機器 (6.0%)		
大日本住友製薬	248	586,520	オークマ	49.6	298,592	デンソー	248	1,372,680
塩野義製薬	248	1,434,928	アマダホールディングス	248	280,736	三井E&SHD	24.8	36,679
中外製薬	248	1,492,960	小松製作所	248	841,464	川崎重工業	24.8	84,692
エーザイ	248	2,027,152	住友重機械	49.6	190,464	日産自動車	248	270,568
第一三共	248	996,216	日立建機	248	922,560	いすゞ自動車	124	189,224
大塚ホールディングス	248	1,357,552	クボタ	248	457,064	トヨタ自動車	248	1,875,376
石油・石炭製品 (0.4%)			荏原製作所	49.6	174,840	日野自動車	248	300,328
昭和シェル石油	248	398,536	ダイキン工業	248	3,297,160	三菱自動車工業	24.8	21,873
JXTGホールディングス	248	189,472	日本精工	248	295,120	マツダ	49.6	70,680
ゴム製品 (0.9%)			N T N	248	115,568	本田技研	496	1,752,368
横浜ゴム	124	299,088	ジェイテクト	248	391,096	スズキ	248	1,594,144
ブリヂストン	248	1,097,152	日立造船	49.6	26,337	S U B A R U	248	840,472
ガラス・土石製品 (1.6%)			三菱重工業	24.8	103,068	ヤマハ発動機	248	748,960
旭硝子	49.6	224,936	I H I	24.8	101,060	精密機器 (3.3%)		
日本板硝子	24.8	27,428	電気機器 (18.4%)			テルモ	496	3,333,120
日本電気硝子	74.4	236,592	日清紡ホールディングス	248	310,496	ニコン	248	446,896
住友大阪セメント	248	131,440	コニカミノルタ	248	263,376	オリンパス	248	1,024,240
太平洋セメント	24.8	100,564	ミネベアミツミ	248	484,840	シチズン時計	248	181,040
東海カーボン	248	526,008	日立	248	202,839	その他製品 (1.3%)		
T O T O	124	698,120	三菱電機	248	377,208	凸版印刷	248	222,456
日本碍子	248	498,976	富士電機	248	212,536	大日本印刷	124	306,156
鉄鋼 (0.2%)			安川電機	248	1,040,360	ヤマハ	248	1,473,120
新日鐵住金	24.8	55,924	ジーエス・ユアサコーポ	248	125,488	電気・ガス業 (0.2%)		
神戸製鋼所	24.8	28,321	日本電気	24.8	77,500	東京電力HD	24.8	12,573

銘 柄		2018年 6 月15日現在	
		株 数	評 価 額
		千株	千円
中部電力		24. 8	42, 048
関西電力		24. 8	40, 300
東京瓦斯		49. 6	148, 527
大阪瓦斯		49. 6	116, 733
陸運業 (2. 4%)			
東武鉄道		49. 6	178, 808
東京急行		124	251, 596
小田急電鉄		124	306, 900
京王電鉄		49. 6	270, 816
京成電鉄		124	490, 420
東日本旅客鉄道		24. 8	274, 784
西日本旅客鉄道		24. 8	203, 409
東海旅客鉄道		24. 8	595, 696
日本通運		24. 8	222, 208
ヤマトホールディングス		248	848, 160
海運業 (0. 1%)			
日本郵船		24. 8	58, 032
商船三井		24. 8	72, 912
川崎汽船		24. 8	56, 320
空運業 (0. 1%)			
ANA ホールディングス		24. 8	110, 360
倉庫・運輸関連業 (0. 2%)			
三菱倉庫		124	295, 120
情報・通信業 (10. 3%)			
ヤフー		99. 2	37, 795
トレンドマイクロ		248	1, 604, 560
スカパー JSATHD		24. 8	12, 871
日本電信電話		49. 6	259, 705
K D D I		1, 488	4, 520, 544
N T T ドコモ		24. 8	70, 890
東宝		24. 8	93, 496
N T T データ		1, 240	1, 595, 880
コナミホールディングス		248	1, 371, 440
ソフトバンクグループ		744	6, 193, 056
卸売業 (2. 3%)			
双日		24. 8	10, 217
伊藤忠		248	529, 356
丸紅		248	217, 272
豊田通商		248	977, 120
三井物産		248	476, 160
住友商事		248	473, 680
三菱商事		248	794, 840
銘 柄		2018年 6 月15日現在	
		株 数	評 価 額
		千株	千円
小売業 (12. 4%)			
J. フロント リテイリング		124	225, 556
三越伊勢丹 H D		248	353, 400
セブン & アイ・HLDGS		248	1, 226, 608
ユニー・ファミリーマート HD		248	2, 988, 400
高島屋		248	234, 360
丸井グループ		248	595, 200
イオン		248	597, 804
ファーストリテイリング		248	12, 734, 800
銀行業 (0. 9%)			
コンソルディア・フィナンシャル		248	158, 968
新生銀行		24. 8	43, 623
あおぞら銀行		24. 8	108, 996
三菱UFJ フィナンシャル G		248	163, 357
りそなホールディングス		24. 8	16, 196
三井住友トラスト HD		24. 8	114, 452
三井住友フィナンシャル G		24. 8	112, 294
千葉銀行		248	214, 520
ふくおかフィナンシャル G		248	149, 792
静岡銀行		248	272, 056
みずほフィナンシャル G		248	47, 591
証券、商品先物取引業 (0. 4%)			
大和証券 G 本社		248	160, 927
野村ホールディングス		248	140, 417
松井証券		248	261, 888
保険業 (1. 0%)			
SOMPO ホールディングス		62	286, 006
M S & A D		74. 4	264, 789
S O N Y F H		49. 6	105, 648
第一生命 HLDGS		24. 8	51, 336
東京海上 H D		124	691, 176
T&D ホールディングス		49. 6	87, 172
その他金融業 (0. 3%)			
クレディセゾン		248	439, 952
不動産業 (1. 7%)			
東急不動産 H D		248	198, 648
三井不動産		248	680, 140
三菱地所		248	506, 664
東京建物		124	191, 456
住友不動産		248	1, 061, 440
サービス業 (4. 3%)			
ディー・エヌ・エー		74. 4	158, 769
銘 柄		2018年 6 月15日現在	
		株 数	評 価 額
		千株	千円
電通		248	1, 304, 480
楽天		248	180, 444
リクルートホールディングス		744	2, 367, 408
日本郵政		248	308, 264
東京ドーム		124	123, 504
セコム		248	2, 050, 960
合 計		千株	千円
株 数、金 額		43, 015. 6	152, 731, 980
銘柄数<比率>		225銘柄	<98. 3%>
(注 1) 銘柄欄の () 内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。			
(注 2) 合計欄の < > 内は、純資産総額に対する評価額の比率。			
(注 3) 評価額の単位未満は切捨て。			
(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)			
銘 柄 別		2018年 6 月15日現在	
		買 建 額	売 建 額
国内		百万円	百万円
	日経平均	2, 671	—
(注) 単位未満は切捨て。			

ストックインデックス 225・マザーファンド

運用報告書 第16期（決算日 2017年 9月19日）

（計算期間 2016年 9月21日～2017年 9月19日）

ストックインデックス 225・マザーファンドの第16期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、日経平均株価をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄
運用方法	投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。 イ．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないます。 ロ．株式の組入比率は、高位を保ちます。
株式組入制限	無制限

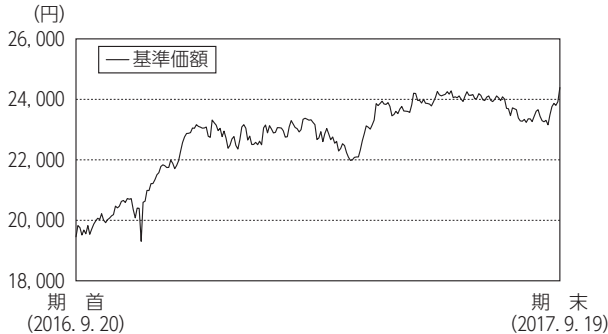
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価 (ベンチマーク)		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
	円	%	円	%	%	%
(期首) 2016年 9月20日	19,454	—	16,492.15	—	98.6	1.4
9月末	19,536	0.4	16,449.84	△ 0.3	98.3	1.7
10月末	20,696	6.4	17,425.02	5.7	98.0	2.0
11月末	21,750	11.8	18,308.48	11.0	98.2	1.8
12月末	22,742	16.9	19,114.37	15.9	98.8	1.2
2017年 1月末	22,654	16.4	19,041.34	15.5	98.5	1.5
2月末	22,764	17.0	19,118.99	15.9	98.3	1.6
3月末	22,665	16.5	18,909.26	14.7	98.0	2.0
4月末	23,015	18.3	19,196.74	16.4	97.5	2.5
5月末	23,569	21.2	19,650.57	19.2	97.9	2.1
6月末	24,055	23.7	20,033.43	21.5	98.2	1.8
7月末	23,925	23.0	19,925.18	20.8	98.8	1.2
8月末	23,605	21.3	19,646.24	19.1	98.4	1.7
(期末) 2017年 9月19日	24,389	25.4	20,299.38	23.1	97.2	1.8

(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：19,454円 期末：24,389円 騰落率：25.4%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内株式市況

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆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、期中に東芝の組み入れを見送り、東芝が日経平均株価採用銘柄より除外された2017年8月からは、すべての銘柄を組み入れて運用を行ないました。

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

◆ベンチマークとの差異について

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

・ファンドには保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークである日経平均株価では配当金の影響が考慮されないことが、プラス要因となりました。

・資金の流出に伴う現物株式および株式先物の売買等によるコスト負担が、マイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

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

(注 2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式
 (2016 年 9 月 21 日から 2017 年 9 月 19 日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。

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

(注 3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種別取引状況

(2016 年 9 月 21 日から 2017 年 9 月 19 日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2016 年 9 月 21 日から 2017 年 9 月 19 日まで)

当 期				期			
買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
大塚ホールディングス	304	1,566,467	5,152	ファーストリテイリング	116	4,514,726	38,920
セイコーエプソン	512	1,498,606	2,926	ソフトバンクグループ	348	2,798,374	8,041
楽天	366	480,247	1,312	ファナック	116	2,446,606	21,091
ファーストリテイリング	14	468,201	33,442	KDDI	696	2,092,719	3,006
ソフトバンクグループ	42	342,411	8,152	東京エレクトロン	116	1,451,911	12,516
ファナック	14	300,506	21,464	京セラ	232	1,402,729	6,046
KDDI	84	249,664	2,972	ダイキン工業	116	1,259,896	10,861
東京エレクトロン	14	181,383	12,955	信越化学	116	1,078,234	9,295
京セラ	28	173,759	6,205	日東電工	116	1,018,089	8,776
ダイキン工業	14	151,488	10,820	テルモ	232	980,424	4,225

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円
水産・農林業 (0.2%)					三井化学	352	250	173,750		住友電工	352	250	443,750	
日本水産	352	250	154,000		三菱ケミカル HLDGS	176	125	135,187		フジクラ	352	250	231,250	
マルハニチロ	35.2	25	82,875		宇部興産	352	250	83,250		金属製品 (0.4%)				
鉱業 (0.1%)					日本化薬	352	250	454,000		SUMCO	35.2	25	42,700	
国際石油開発帝石	140.8	100	111,150		花王	352	250	1,711,000		東洋製罐グループHD	352	250	477,250	
建設業 (2.9%)					富士フイルム HLDGS	352	250	1,095,750		機械 (5.3%)				
コムシスホールディングス	352	250	635,500		資生堂	352	250	1,147,500		日本製鋼所	352	50	130,750	
大成建設	352	250	293,000		日東電工	352	250	2,441,250		オークマ	352	250	281,500	
大林組	352	250	325,000		医薬品 (7.5%)					アマダホールディングス	352	250	310,500	
清水建設	352	250	299,750		協和発酵キリン	352	250	466,000		小松製作所	352	250	792,000	
長谷工コーポレーション	70.4	50	70,550		武田薬品	352	250	1,547,750		住友重機械	352	250	223,250	
鹿島建設	352	250	259,500		アステラス製薬	1,760	1,250	1,832,500		日立建機	352	250	808,750	
大和ハウス	352	250	962,250		大日本住友製薬	352	250	369,750		クボタ	352	250	503,500	
積水ハウス	352	250	466,375		塩野義製薬	352	250	1,489,750		荏原製作所	352	50	182,750	
日揮	352	250	433,000		中外製薬	352	250	1,165,000		ダイキン工業	352	250	2,828,750	
千代田化工建	352	250	153,000		エーザイ	352	250	1,467,250		日本精工	352	250	365,500	
食料品 (4.9%)					第一三共	352	250	652,500		N T N	352	250	117,500	
日清製粉G本社	352	250	489,750		大塚ホールディングス	—	250	1,094,500		ジェイテクト	352	250	382,750	
明治ホールディングス	70.4	50	437,000		石油・石炭製品 (0.3%)					日立造船	70.4	50	28,800	
日本ハム	352	250	786,250		昭和シエル石油	352	250	305,250		三菱重工業	352	250	109,175	
サッポロホールディングス	70.4	50	159,500		JXTGホールディングス	352	250	141,425		I H I	352	250	96,250	
アサヒグループホールディン	352	250	1,146,000		ゴム製品 (1.1%)					電気機器 (19.9%)				
キリンHD	352	250	632,750		横浜ゴム	176	125	280,625		日清紡ホールディングス	352	250	331,750	
宝ホールディングス	352	250	266,000		ブリヂストン	352	250	1,256,250		コニカミノルタ	352	250	232,500	
キッコーマン	352	250	878,750		ガラス・土製品 (1.6%)					ミネベアミツミ	352	250	474,750	
味の素	352	250	542,375		旭硝子	352	50	208,250		日立	352	250	198,275	
ニチレイ	352	125	361,250		日本板硝子	352	25	21,250		東芝	352	—	—	
日本たばこ産業	352	250	930,000		日本電気硝子	528	75	318,750		三菱電機	352	250	438,750	
繊維製品 (0.3%)					住友大阪セメント	352	250	125,000		富士電機	352	250	157,000	
東洋紡	352	250	49,750		太平洋セメント	352	250	109,750		安川電機	352	250	902,500	
ユニチカ	352	250	20,750		東海カーボン	352	250	225,000		明電舎	352	250	100,750	
帝人	352	50	114,550		T O T O	176	125	551,875		ジーエス・ユアサ コーポ	352	250	145,500	
東レ	352	250	271,375		日本碍子	352	250	531,000		日本電気	352	250	74,750	
パルプ・紙 (0.3%)					鉄鋼 (0.2%)					富士通	352	250	211,525	
王子ホールディングス	352	250	148,750		新日鐵住金	35.2	25	67,800		沖電気	352	25	37,600	
日本製紙	35.2	25	51,950		神戸製鋼所	352	25	33,575		セイコーエプソン	—	500	1,411,500	
北越紀州製紙	352	250	173,000		J F Eホールディングス	35.2	25	55,887		パナソニック	352	250	412,875	
化学 (9.3%)					日新製鋼	35.2	25	35,525		ソニー	352	250	1,073,500	
クラレ	352	250	532,000		大平洋金属	352	250	78,000		T D K	352	250	1,880,000	
旭化成	352	250	349,750		非鉄金属 (1.5%)					ミツミ電機	352	—	—	
昭和電工	35.2	25	84,125		日本軽金属HD	352	250	82,750		アルプス電気	352	250	758,750	
住友化学	352	250	176,750		三井金属	352	250	149,000		パイオニア	352	250	51,500	
日産化学	352	250	1,020,000		東邦亜鉛	352	250	122,500		横河電機	352	250	471,750	
日本曹達	352	—	—		三菱マテリアル	352	25	99,250		アドバンテス	704	500	1,058,500	
東ソー	352	250	324,000		住友鉱山	352	250	489,000		カシオ	352	250	394,250	
トクヤマ	352	250	129,750		DOWAホールディングス	352	250	205,750		ファナック	352	250	5,688,750	
デンカ	352	250	183,250		古河機金	352	250	48,750		京セラ	704	500	3,491,500	
信越化学	352	250	2,540,000		古河電工	352	25	157,250		太陽誘電	352	250	435,500	

ストックインデックス225・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
SCREENホールディングス	352	50	380,000		倉庫・運輸関連業 (0.3%)					第一生命HLDGS	35.2	25	47,487	
キヤノン	528	375	1,438,875		三菱倉庫	352	250	349,000		東京海上HD	176	125	565,625	
リコー	352	250	275,000		情報・通信業 (11.8%)					T&Dホールディングス	70.4	50	78,375	
東京エレクトロン	352	250	4,307,500		ヤフー	140.8	100	50,600		その他金融業 (0.4%)				
輸送用機器 (6.7%)					トレンドマイクロ	352	250	1,402,500		クレディセゾン	352	250	513,750	
デンソー	352	250	1,375,500		スカパーJSATHD	35.2	25	12,650		不動産業 (1.7%)				
三井造船	352	250	35,500		日本電信電話	70.4	50	256,750		東急不動産HD	352	250	164,250	
川崎重工業	352	250	91,750		KDDI	2,112	1,500	4,471,500		三井不動産	352	250	584,250	
日産自動車	352	250	288,250		NTTドコモ	35.2	25	64,587		三菱地所	352	250	475,000	
いすゞ自動車	176	125	186,312		東宝	35.2	25	98,250		東京建物	176	125	172,875	
トヨタ自動車	352	250	1,682,250		NTTデータ	352	1,250	1,500,000		住友不動産	352	250	859,750	
日野自動車	352	250	340,000		コナミホールディングス	352	250	1,407,500		サービス業 (2.9%)				
三菱自動車工業	35.2	25	21,625		ソフトバンクグループ	1,056	750	6,678,000		ディー・エヌ・エー	105.6	75	182,775	
マツダ	70.4	50	82,950		卸売業 (2.3%)					電通	352	250	1,178,750	
本田技研	704	500	1,647,000		双日	35.2	25	7,675		楽天	—	250	312,500	
スズキ	352	250	1,532,000		伊藤忠	352	250	458,250		東京ドーム	176	125	125,875	
SUBARU	352	250	995,000		丸紅	352	250	185,725		セコム	352	250	2,081,500	
ヤマハ発動機	352	250	818,750		豊田通商	352	250	915,000						
精密機器 (2.9%)					三井物産	352	250	421,625		株数・金額	73,339.2	50,187.5	134,894,422	
テルモ	704	500	2,262,500		住友商事	352	250	402,125		銘柄数<比率>	225銘柄	225銘柄	<97.2%>	
ニコン	352	250	472,500		三菱商事	352	250	655,125						
オリンパス	352	250	966,250		小売業 (9.1%)									
シチズン時計	352	250	194,750		J.フロントリテイリング	176	125	187,125						
その他製品 (1.2%)					三越伊勢丹HD	352	250	287,500						
凸版印刷	352	250	278,500		セブン&アイ・HLDGS	352	250	1,101,750						
大日本印刷	352	250	331,250		ユニー・ファミリーマートHD	352	250	1,432,500						
ヤマハ	352	250	977,500		高島屋	352	250	260,750						
電気・ガス業 (0.2%)					丸井グループ	352	250	406,750						
東京電力HD	35.2	25	11,450		イオン	352	250	409,625						
中部電力	35.2	25	35,962		ファーストリテイリング	352	250	8,200,000						
関西電力	35.2	25	38,512		銀行業 (1.0%)									
東京瓦斯	352	250	143,625		コンソルディア・フィナンシャル	352	250	139,525						
大阪瓦斯	352	250	107,125		新生銀行	352	250	43,750						
陸運業 (2.2%)					あおぞら銀行	352	250	106,750						
東武鉄道	352	250	156,250		三菱UFJフィナンシャルG	352	250	177,225						
東京急行	352	125	200,625		リソナホールディングス	35.2	25	13,822						
小田急電鉄	352	125	267,625		三井住友トラストHD	352	25	99,375						
京王電鉄	352	250	234,750		三井住友フィナンシャルG	35.2	25	107,200						
京成電鉄	352	125	388,125		千葉銀行	352	250	190,250						
東日本旅客鉄道	35.2	25	254,875		ふくおかフィナンシャルG	352	250	122,000						
西日本旅客鉄道	35.2	25	196,925		静岡銀行	352	250	249,000						
東海旅客鉄道	35.2	25	485,875		みずほフィナンシャルG	352	250	48,950						
日本通運	352	250	185,250		証券・商品先物取引業 (0.4%)									
ヤマトホールディングス	352	250	579,000		大和証券G本社	352	250	158,525						
海運業 (0.2%)					野村ホールディングス	352	250	157,925						
日本郵船	352	250	58,000		松井証券	352	250	215,000						
商船三井	352	250	87,750		保険業 (1.0%)									
川崎汽船	352	250	73,250		SOMPOホールディングス	88	62.5	283,062						
空運業 (0.1%)					MS&AD	105.6	75	273,750						
ANAホールディングス	352	250	104,925		SONYFH	70.4	50	89,100						

■投資信託財産の構成

2017年9月19日現在		
項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 134,894,422	% 96.9
コール・ローン等、その他	4,323,590	3.1
投資信託財産総額	139,218,012	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年9月19日現在	
項 目	当 期 末
(A)資産	140,008,002,801円
コール・ローン等	1,979,025,274
株式（評価額）	134,894,422,500
未収入金	2,254,062,027
未収配当金	90,503,000
差入委託証拠金	789,990,000
(B)負債	1,251,758,000
未払解約金	385,458,000
差入委託証拠金代用有価証券	866,300,000
(C)純資産総額（A－B）	138,756,244,801
元本	56,891,999,288
次期繰越損益金	81,864,245,513
(D)受益権総口数	56,891,999,288口
1万口当り基準価額（C／D）	24,389円

* 期首における元本額は78,725,801,897円、当期中における追加設定元本額は9,750,934,005円、同解約元本額は31,584,736,614円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ストックインデックスファンド225 29,839,637,905円、適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド225V A934,940,216円、大和ストックインデックス225ファンド10,398,001,066円、D－I's日経225インデックス102,430,549円、iFree日経225インデックス103,304,273円、D C・ダイワ・ストックインデックス225（確定拠出年金専用ファンド）5,031,285,400円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト12Ver2ー227,152,665円、ダイワ・ノーロード日経225ファンド155,766,009円、ダイワファンドラップ日経225インデックス1,669,599,472円、ダイワ日経225インデックス（ダイワS M A 専用）428,154円、ダイワ・インデックスセレクト日経225 8,429,453,579円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,389円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月21日 至2017年9月19日	
項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,774,846,036円
受取配当金	2,775,725,064
その他収益金	436,564
支払利息	△ 1,315,592
(B) 有価証券売買損益	32,230,575,612
売買益	34,058,409,010
売買損	△ 1,827,833,398
(C) 先物取引等損益	753,493,940
取引益	917,437,479
取引損	△ 163,943,539
(D) その他費用	△ 224,792
(E) 当期損益金（A＋B＋C＋D）	35,758,690,796
(F) 前期繰越損益金	74,425,073,074
(G) 解約差損益金	△ 40,378,052,352
(H) 追加信託差損益金	12,058,533,995
(I) 合計（E＋F＋G＋H）	81,864,245,513
次期繰越損益金（I）	81,864,245,513

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

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

ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用)

★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	①主として海外の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。 ③運用の効率化を図るため、株式指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等の組入総額ならびに株式指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。		
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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、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。

運用報告書(全体版) 第 2 期 (決算日 2018年 6 月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
1 期末(2017年 6 月15日)	10, 413	60	4. 7	10, 395	4. 0	94. 0	3. 8	0. 0	2. 5	3
2 期末(2018年 6 月15日)	11, 436	100	10. 8	11, 319	8. 9	96. 6	3. 4	—	2. 3	1, 333

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) 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 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) 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) 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1）期末の基準価額は分配金込みです。

（注2）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）です。

■基準価額・騰落率

期首：10,413円

期末：11,436円（分配金100円）

騰落率：10.8%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

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

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

年 月 日	基 準 価 額		M S C I コクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首)2017年 6 月15日	10,413	—	10,395	—	94.0	3.8	0.0	2.5
6 月末	10,320	△ 0.9	10,293	△ 1.0	95.9	3.5	0.0	2.5
7 月末	10,459	0.4	10,429	0.3	94.2	2.4	0.0	2.6
8 月末	10,398	△ 0.1	10,344	△ 0.5	95.3	2.3	0.0	2.7
9 月末	10,637	2.2	10,570	1.7	97.3	2.7	0.0	2.6
10月末	10,892	4.6	10,818	4.1	94.9	2.7	0.0	2.5
11月末	11,024	5.9	10,930	5.1	92.8	3.6	0.0	2.5
12月末	11,217	7.7	11,109	6.9	94.5	4.2	0.0	2.5
2018年 1 月末	11,597	11.4	11,486	10.5	92.1	3.4	0.0	2.3
2 月末	11,289	8.4	11,161	7.4	91.8	3.6	0.0	2.2
3 月末	10,908	4.8	10,768	3.6	92.3	4.7	0.0	2.3
4 月末	11,109	6.7	10,949	5.3	96.0	4.1	0.0	2.4
5 月末	11,305	8.6	11,103	6.8	94.4	1.8	—	2.3
(期末)2018年 6 月15日	11,536	10.8	11,319	8.9	96.6	3.4	—	2.3

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■外国株式市況

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

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマーク（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。

ポートフォリオについて

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■当ファンド

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の受益証券組入比率を期を通じておおむね100%程度に維持しました。なお期末のマザーファンド組入比率は100.9%となっておりますが、翌営業日計上のマザー解約金額を考慮したマザーファンド実質組入比率は100%程度となっております。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

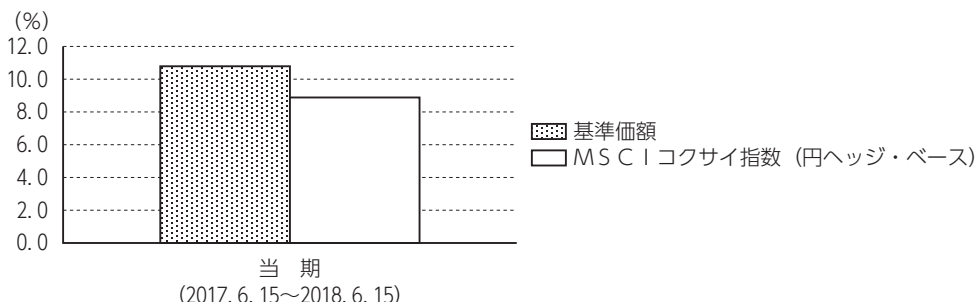
ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式（リート、株式先物を含む。）のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

当期のベンチマークの騰落率は8.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は10.8%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は100円といたしました。
収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年6月16日 ～2018年6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	100
対基準価額比率	(%)	0.87
当期の収益	(円)	50
当期の収益以外	(円)	50
翌期繰越分配対象額	(円)	1,436

- (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。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	63.56円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	321.83
(c) 収益調整金	1,149.86
(d) 分配準備積立金	0.94
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	1,536.20
(f) 分配金	100.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	1,436.20

- (注) 下線を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 6. 16～2018. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	48円	0. 437%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10, 940円です。
(投 信 会 社)	(34)	(0. 308)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(12)	(0. 108)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0. 022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0. 013	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(1)	(0. 010)	
(先 物)	(0)	(0. 003)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0. 000)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
有価証券取引税	3	0. 027	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(3)	(0. 026)	
(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	10	0. 087	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(7)	(0. 066)	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)	(2)	(0. 015)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	62	0. 565	

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

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	708,494	1,296,066	295	541

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

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

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■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

期首保有額	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

(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	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	2,132	710,331	1,345,084

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス 為替ヘッジ型マザーファンド	1,345,084	99.9
コール・ローン等、その他	1,077	0.1
投資信託財産総額	1,346,162	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	1,346,162,198円
コール・ローン等	1,077,866
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（評価額）	1,345,084,332
(B)負債	12,642,058
未払収益分配金	11,660,513
未払信託報酬	969,649
その他未払費用	11,896
(C)純資産総額（A－B）	1,333,520,140
元本	1,166,051,379
次期繰越損益金	167,468,761
(D)受益権総口数	1,166,051,379口
1万口当り基準価額（C／D）	11,436円

*期首における元本額は3,466,456円、当期中における追加設定元本額は1,162,584,923円、同解約元本額は0円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は11,436円です。

■損益の状況

当期 自 2017年 6月16日 至 2018年 6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 40円
支払利息	△ 40
(B) 有価証券売買損益	45, 929, 300
売買益	45, 932, 922
売買損	△ 3, 622
(C) 信託報酬等	△ 989, 719
(D) 当期損益金 (A + B + C)	44, 939, 541
(E) 前期繰越損益金	109, 634
(F) 追加信託差損益金	134, 080, 099
(配当等相当額)	(40, 896, 577)
(売買損益相当額)	(93, 183, 522)
(G) 合計 (D + E + F)	179, 129, 274
(H) 収益分配金	△ 11, 660, 513
次期繰越損益金 (G + H)	167, 468, 761
追加信託差損益金	128, 249, 843
(配当等相当額)	(35, 066, 321)
(売買損益相当額)	(93, 183, 522)
分配準備積立金	39, 218, 918

■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	7, 412, 452円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	37, 527, 089
(c) 収益調整金	134, 080, 099
(d) 分配準備積立金	109, 634
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	179, 129, 274
(f) 分配金	11, 660, 513
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	167, 468, 761
(h) 受益権総口数	1, 166, 051, 379口

- (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 お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	100円

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（2018年1月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を63～91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

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

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

(1)外国株式

銘 柄	2018年 6 月15日現在			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	11	126	13,987	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	8	172	19,086	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	16.59	101	11,241	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5.5	97	10,788	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	62	218	24,195	金融
ABBOTT LABORATORIES	150.97	950	105,202	ヘルスケア
ARCONIC INC	39.5	71	7,869	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	11.35	124	13,814	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	34	274	30,330	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	24	218	24,225	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	27.5	296	32,786	情報技術
QORVO INC	11.79	98	10,915	情報技術
AFLAC INC	70.68	322	35,734	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	12.48	115	12,734	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN		10	46	5,152	一般消費財・サービス
ADOBE SYSTEMS INC		43.22	1,115	123,464	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		17.5	78	8,700	素材
LULULEMON ATHLETICA INC		10.08	126	14,043	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL		44.09	82	9,169	金融
GARMIN LTD		7.5	46	5,141	一般消費財・サービス
AETNA INC		29.32	551	61,037	ヘルスケア
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC		19.42	321	35,619	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC		65.31	987	109,295	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC		17.1	149	16,492	情報技術
WR BERKLEY CORP		6	45	4,999	金融
AUTOZONE INC		2.4	163	18,142	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC		19.11	168	18,684	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR		73.54	174	19,355	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL		9	67	7,511	公益事業
CELANESE CORP-SERIES A		12.97	149	16,522	素材
DR HORTON INC		33.06	142	15,763	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK		4.5	28	3,200	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC		24.5	109	12,172	ヘルスケア
AUTODESK INC		19.13	264	29,305	情報技術
MOODY'S CORP		14.9	262	29,013	金融
DEVON ENERGY CORP		48.68	203	22,472	エネルギー
ALBEMARLE CORP		8	74	8,293	素材
ATMOS ENERGY CORP		10.5	89	9,957	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP		22	87	9,647	公益事業
CITIGROUP INC		223.28	1,477	163,498	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING		36.87	515	57,057	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER		44.53	287	31,848	公益事業
ALLEGHANY CORP		1.38	80	8,883	金融
DOMINO'S PIZZA INC		3	82	9,086	一般消費財・サービス
HESS CORP		28.96	176	19,542	エネルギー
DAVITA INC		10	71	7,862	ヘルスケア
DANAHER CORP		54.31	557	61,697	ヘルスケア
FORTIVE CORP		30.44	243	26,996	資本財・サービス
AVNET INC		11	44	4,891	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN		53.14	395	43,829	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A		12	28	3,117	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		17.01	36	4,091	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		45.84	207	22,952	生活必需品
BUNGE LTD		9.5	67	7,418	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD		32.46	322	35,678	情報技術
APPLE INC		441.42	8,422	932,179	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		33.59	252	27,957	金融
BOEING CO/THE		47.47	1,720	190,414	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP		14.5	99	11,060	金融
BECTON DICKINSON AND CO		22.83	531	58,829	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR		15	44	4,947	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC		14	85	9,413	情報技術
CDK GLOBAL INC		11	72	8,018	情報技術
NISOURCE INC		40.26	96	10,689	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		10.5	94	10,509	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		86.06	488	54,102	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC		354.73	1,696	187,748	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		110.2	2,121	234,791	金融
ANSYS INC		7.2	127	14,098	情報技術
H&R BLOCK INC		16	38	4,209	一般消費財・サービス
BB&T CORP		69.55	364	40,367	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		140.41	753	83,344	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO		297.28	3,211	355,450	金融
T ROWE PRICE GROUP INC		22.75	281	31,137	金融
CIGNA CORP		20.45	358	39,684	ヘルスケア
LKQ CORP		33	109	12,107	一般消費財・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD		5.47	67	7,504	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		26.52	140	15,539	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC		26.5	119	13,180	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC		12	177	19,610	金融
DOLLAR GENERAL CORP		21.98	211	23,434	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC		13.91	257	28,534	情報技術
CATERPILLAR INC		52.28	800	88,612	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP		25	109	12,069	公益事業
MOSAIC CO/THE		30	88	9,788	素材
DELTA AIR LINES INC		16.5	90	10,025	資本財・サービス
CORNING INC		70.47	203	22,533	情報技術
CISCO SYSTEMS INC		423.66	1,893	209,554	情報技術
MORGAN STANLEY		115.15	590	65,393	金融
WABCO HOLDINGS INC		3.2	39	4,355	資本財・サービス
MSCI INC		7.3	125	13,925	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC		4.5	95	10,534	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP		4	42	4,700	資本財・サービス
COTY INC-CL A		47.57	67	7,507	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		17.34	91	10,175	情報技術
BROADCOM INC		36.09	968	107,234	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP		3	34	3,790	ヘルスケア
ACUITY BRANDS INC		3.5	42	4,678	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		7	74	8,294	ヘルスケア
ARAMARK		17	67	7,481	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		14	43	4,834	素材
DTE ENERGY COMPANY		13.5	131	14,501	公益事業
CENTENE CORP		15.5	191	21,186	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC		9	93	10,340	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP		40.5	167	18,557	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO		17.97	118	13,122	金融
GARTNER INC		8	109	12,156	情報技術
SPLUNK INC		11	131	14,548	情報技術
AGCO CORP		5	30	3,413	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC		55.8	365	40,464	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP		33.5	187	20,782	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP		14	89	9,912	資本財・サービス
DEERE & CO		26.86	403	44,646	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC		12	141	15,639	情報技術
TIME WARNER INC		68.88	680	75,298	一般消費財・サービス
VMWARE INC-CLASS A		5	75	8,314	情報技術

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
CHEMOURS CO/THE		14	69	7,713	素材
NASDAQ INC		8.5	80	8,915	金融
VAIL RESORTS INC		3.9	109	12,132	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC		14.61	102	11,348	金融
TARGA RESOURCES CORP		20.29	98	10,896	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		4.5	64	7,146	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC		8.74	95	10,618	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP		4.05	45	5,033	素材
CONSOLIDATED EDISON INC		29.94	219	24,273	公益事業
COGNEX CORP		14	64	7,093	情報技術
TELEFLEX INC		4.85	137	15,253	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		8.06	104	11,565	資本財・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		12.25	101	11,257	ヘルスケア
IDEX CORP		7	100	11,130	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO		68.51	433	48,005	生活必需品
ROLLINS INC		7	36	4,049	資本財・サービス
AMETEK INC		19.82	148	16,417	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC		21.55	107	11,878	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION		10	41	4,627	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC		10.6	118	13,100	資本財・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A		28.2	321	35,628	素材
COSTCO WHOLESALE CORP		38.64	792	87,723	生活必需品
SCANA CORP		7	25	2,858	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP		4	62	6,884	金融
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		2.4	110	12,230	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN		28	63	6,975	金融
UGI CORP		20.9	102	11,392	公益事業
CUMMINS INC		13	184	20,415	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC		65.65	510	56,465	情報技術
SABRE CORP		16	42	4,676	情報技術
CDW CORP/DE		13	108	12,063	情報技術
SIGNATURE BANK		3.5	44	4,883	金融
COSTAR GROUP INC		3.82	156	17,322	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP		4.5	142	15,763	金融
AMERCO		0.7	24	2,727	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE		4.4	70	7,805	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC		3.83	116	12,929	情報技術
HANESBRANDS INC		29	58	6,474	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC		8.37	109	12,144	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN		23.13	191	21,230	一般消費財・サービス
COMMScope HOLDING CO INC		22.45	67	7,521	情報技術
IPG PHOTONICS CORP		2.5	60	6,672	情報技術
COPART INC		17.78	103	11,429	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC		9.79	113	12,563	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC		10	65	7,248	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC		6.5	238	26,350	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC		5	172	19,046	資本財・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC		25	78	8,724	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC		171.69	291	32,209	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC		26.89	285	31,550	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP		46.08	108	12,041	エネルギー

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	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
T-MOBILE US INC		26	154	17,130	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C		7	45	5,042	情報技術
COCA-COLA CO/THE		354.29	1,543	170,889	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		16	63	6,994	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC		12.5	95	10,621	資本財・サービス
EATON VANCE CORP		12.5	68	7,594	金融
FRANKLIN RESOURCES INC		22	72	8,071	金融
CSX CORP		70.81	466	51,639	資本財・サービス
FLUOR CORP		12.9	63	6,980	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS		7.5	140	15,595	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC		11.5	142	15,729	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC		8	127	14,089	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC		35.28	6,081	673,131	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A		16	44	4,908	エネルギー
FLOWSERVE CORP		9	37	4,137	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP		19.45	294	32,626	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP		368.52	3,017	334,011	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC		8	43	4,807	情報技術
AES CORP		40	52	5,835	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC		6.5	128	14,227	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD		3.5	79	8,754	金融
EOG RESOURCES INC		50.99	599	66,328	エネルギー
EQT CORP		19	106	11,809	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC		12.5	101	11,186	情報技術
ABIOMED INC		3.55	156	17,313	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP		13.6	126	14,051	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC		25	165	18,347	ヘルスケア
FORD MOTOR CO		321.29	382	42,281	一般消費財・サービス
MACY'S INC		22	82	9,145	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A		11	28	3,104	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A		24.16	71	7,875	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC-C		21.49	51	5,744	一般消費財・サービス
AERCAP HOLDINGS NV		18.24	99	11,012	資本財・サービス
FORTINET INC		10.5	69	7,639	情報技術
MARKEL CORP		1.1	120	13,391	金融
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A		8	20	2,277	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC		40.5	643	71,191	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC		114.5	201	22,278	素材
US BANCORP		142.81	727	80,501	金融
UNITED RENTALS INC		6	98	10,921	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC		5.5	99	11,057	情報技術
FASTENAL CO		29.07	153	16,985	資本財・サービス
FISERV INC		35	267	29,607	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO		733.08	999	110,671	資本財・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS		14.01	79	8,747	ヘルスケア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN		21.49	117	12,951	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO		22.5	56	6,250	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO		108.49	472	52,317	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC		7	40	4,472	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP		20.61	403	44,668	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC		31.14	727	80,529	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2018年 6月15日現在		業 種 等
		評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ALPHABET INC-CL A	25. 61	2, 971	328, 834	情報技術
ALPHABET INC-CL C	26. 56	3, 060	338, 684	情報技術
OWENS CORNING	8	52	5, 773	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	44. 5	198	21, 922	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	44. 88	153	17, 023	公益事業
GENUINE PARTS CO	12	112	12, 494	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	33. 55	170	18, 848	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	58. 5	180	19, 968	金融
HARRIS CORP	9. 82	147	16, 297	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9. 5	40	4, 529	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	78. 26	373	41, 342	エネルギー
HOME DEPOT INC	100. 09	1, 998	221, 193	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	7. 8	74	8, 266	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	107. 45	165	18, 338	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3. 5	76	8, 520	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	13. 58	125	13, 848	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	14	61	6, 848	一般消費財・サービス
HUMANA INC	12. 88	392	43, 398	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	28. 5	322	35, 647	情報技術
HELMERICH & PAYNE	13. 36	86	9, 607	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	11	80	8, 872	ヘルスケア
HP INC	141. 5	336	37, 273	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	132. 5	209	23, 200	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	11	51	5, 671	一般消費財・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	11	80	8, 882	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13. 5	45	4, 987	一般消費財・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	8. 5	39	4, 362	一般消費財・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	12	97	10, 775	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	50. 98	309	34, 232	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	80. 62	1, 170	129, 562	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	30. 5	173	19, 187	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	85	9, 429	資本財・サービス
ZOETIS INC	41	361	40, 001	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	20. 44	187	20, 792	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	17. 5	113	12, 576	エネルギー
ALLEGION PLC	11. 1	90	10, 048	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	15. 72	69	7, 699	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	51. 08	146	16, 259	一般消費財・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	20	152	16, 900	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	28. 5	79	8, 775	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	9	93	10, 334	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	229. 84	2, 813	311, 395	ヘルスケア
ABBVIE INC	135. 27	1, 335	147, 845	ヘルスケア
HOLOGIC INC	30. 42	122	13, 544	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	31. 41	320	35, 473	生活必需品
KROGER CO	71. 6	187	20, 730	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	15. 2	171	19, 032	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	22. 88	710	78, 652	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7. 3	150	16, 606	情報技術
L BRANDS INC	19. 5	70	7, 767	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	71. 06	704	77, 988	一般消費財・サービス

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	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
ELI LILLY & CO		86.98	751	83,128	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP		14.77	267	29,616	情報技術
JONES LANG LASALLE INC		3	51	5,661	不動産
LOEWS CORP		25.5	126	14,001	金融
LINCOLN NATIONAL CORP		18	122	13,557	金融
MCDONALD'S CORP		68.43	1,143	126,520	一般消費財・サービス
3M CO		52.52	1,069	118,368	資本財・サービス
FACEBOOK INC-A		208.18	4,097	453,477	情報技術
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V		17.17	150	16,706	情報技術
MANPOWERGROUP INC		6.5	60	6,695	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC		21.4	443	49,097	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS		5.4	124	13,758	素材
CONCHO RESOURCES INC		12	152	16,900	エネルギー
FIRST DATA CORP- CLASS A		38.5	83	9,208	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC		19	69	7,688	電気通信サービス
PHILLIPS 66		38.47	444	49,199	エネルギー
TECHNIPFMC PLC		45.61	146	16,234	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL		39	122	13,566	一般消費財・サービス
MATTEL INC		36	64	7,140	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO		24.29	205	22,703	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		10.29	108	12,056	生活必需品
MYLAN NV		48.88	193	21,375	ヘルスケア
METLIFE INC		75.19	351	38,922	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD		37.34	81	8,992	情報技術
ARISTA NETWORKS INC		4.23	118	13,161	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A		13.49	62	6,956	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC		14.35	163	18,090	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL		2.1	124	13,776	ヘルスケア
BAKER HUGHES A GE CO		37.84	127	14,105	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC		11	196	21,785	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC		5.36	24	2,685	金融
MERCK & CO. INC.		236.14	1,453	160,893	ヘルスケア
DOWDUPONT INC		203.58	1,392	154,075	素材
MASCO CORP		22	84	9,355	資本財・サービス
M & T BANK CORP		13.23	231	25,582	金融
MARSH & MCLENNAN COS		45.04	369	40,847	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A		27.83	386	42,738	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A		12	153	17,027	情報技術
SQUARE INC - A		27.91	178	19,733	情報技術
TRANSUNION		20.15	143	15,896	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP		25	60	6,643	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD		11	72	8,017	一般消費財・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A		28.76	242	26,837	情報技術
NETAPP INC		23	178	19,728	情報技術
NIKE INC -CL B		108.66	811	89,837	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP		25.53	391	43,365	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		20.5	210	23,272	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		10.5	103	11,441	金融
ALLY FINANCIAL INC		33	86	9,620	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP		14.4	464	51,409	資本財・サービス
APTIV PLC		21	215	23,849	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘	柄	2018年6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
NEWMONT MINING CORP		41.5	162	17,987	素材
MCKESSON CORP		17.69	265	29,368	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		23.87	146	16,229	情報技術
XYLEM INC		13	93	10,320	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		136.09	1,100	121,779	生活必需品
NUCOR CORP		27	185	20,479	素材
WESTERN UNION CO		36	74	8,231	情報技術
GODADDY INC - CLASS A		13	95	10,582	情報技術
NEWELL BRANDS INC		40.58	107	11,852	一般消費財・サービス
EVERGY INC		9	46	5,174	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		67.97	573	63,455	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C		8	61	6,773	一般消費財・サービス
PAYCHEX INC		26.75	185	20,529	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		7	197	21,839	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC		164.46	932	103,207	生活必需品
P G & E CORP		41	163	18,101	公益事業
PFIZER INC		510.16	1,844	204,175	ヘルスケア
ALKERMES PLC		10.5	52	5,826	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC		40.5	173	19,216	公益事業
STRYKER CORP		28.18	475	52,632	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP		12.39	212	23,574	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO		13.53	259	28,669	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC		4	51	5,724	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE		216.56	1,645	182,139	生活必需品
EXELON CORP		78.54	322	35,701	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC		17.5	210	23,273	ヘルスケア
NVR INC		0.3	93	10,341	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS		97.88	666	73,807	エネルギー
PEPSICO INC		120.83	1,270	140,595	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		35.5	350	38,800	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC		13.5	107	11,920	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A		51.65	840	93,043	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD		6	33	3,762	金融
PENTAIR PLC		15.75	68	7,631	資本財・サービス
QUALCOMM INC		125.36	745	82,499	情報技術
INVESCO LTD		37	100	11,142	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC		5	66	7,387	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		23	129	14,321	金融
RAYTHEON COMPANY		25.67	520	57,584	資本財・サービス
RED HAT INC		15.3	269	29,786	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS		7.45	235	26,029	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC		20.5	141	15,707	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC		4.23	898	99,396	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC		30.35	256	28,384	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA		8.44	101	11,282	素材
RESMED INC		13.83	147	16,341	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC		12	133	14,734	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC		8	55	6,191	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP		4	55	6,157	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC		13.1	180	19,991	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP		92.5	172	19,062	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
CHEVRON CORP		166.61	2,107	233,289	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL		31.03	186	20,675	公益事業
TESLA INC		11.94	427	47,273	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP		54	115	12,766	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC		12.18	173	19,181	資本財・サービス
SYNOPSYS INC		11	99	11,063	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		16.1	475	52,676	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A		28	135	14,968	不動産
TWITTER INC		57	266	29,499	情報技術
SOUTHERN CO/THE		89.27	394	43,681	公益事業
SYSCO CORP		43.92	291	32,316	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE		24.82	319	35,398	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY		10	65	7,272	金融
STERICYCLE INC		5	32	3,553	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC		23	112	12,476	素材
SCHLUMBERGER LTD		111.32	760	84,188	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		10.5	56	6,254	資本財・サービス
AT&T INC		535.63	1,741	192,790	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO		9	46	5,173	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP		36.27	93	10,393	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE		7.61	305	33,792	素材
SEMPRA ENERGY		20.68	234	25,937	公益事業
TIFFANY & CO		10.86	147	16,307	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY		23.49	138	15,360	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC		85.51	980	108,573	情報技術
SALESFORCE.COM INC		60.07	831	92,022	情報技術
WESTROCK CO		23.21	140	15,541	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION		83.88	292	32,391	資本財・サービス
ANDEAVOR		15.2	211	23,387	エネルギー
UNION PACIFIC CORP		69.46	1,006	111,427	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP		61	128	14,259	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP		41.75	313	34,744	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP		65.43	830	91,927	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		60.33	707	78,251	資本財・サービス
UNUM GROUP		19	73	8,165	金融
SPRINT CORP		41.14	22	2,486	電気通信サービス
ANTERO RESOURCES CORP		10	19	2,187	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC		14.32	147	16,350	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC		18	93	10,299	金融
AMEREN CORPORATION		18.5	104	11,542	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC		82.66	2,110	233,596	ヘルスケア
VERISIGN INC		7.5	105	11,722	情報技術
VALERO ENERGY CORP		38.82	453	50,192	エネルギー
ULTA BEAUTY INC		4.8	118	13,100	一般消費財・サービス
FNF GROUP		17.5	66	7,400	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		6	68	7,609	ヘルスケア
ANTHEM INC		21.49	519	57,498	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE		128.29	1,395	154,415	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO		408.06	2,233	247,228	金融
WASTE MANAGEMENT INC		36.64	306	33,890	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC		77.9	211	23,460	エネルギー

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
TRACTOR SUPPLY COMPANY		10. 5	78	8, 637	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP		5	77	8, 603	一般消費財・サービス
WALMART INC		130. 54	1, 093	121, 061	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A		9	79	8, 793	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		15. 5	178	19, 708	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD		7. 17	126	13, 986	一般消費財・サービス
XEROX CORP		19. 88	55	6, 103	情報技術
WABTEC CORP		11. 05	112	12, 475	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC		56. 03	529	58, 640	一般消費財・サービス
WATERS CORP		6. 5	130	14, 407	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS		3. 5	25	2, 828	資本財・サービス
ALLERGAN PLC		28. 49	495	54, 851	ヘルスケア
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		73. 2	474	52, 556	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC		10. 36	161	17, 892	金融
WESTERN DIGITAL CORP		25. 45	210	23, 252	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC		28. 69	171	19, 007	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP		42. 5	221	24, 563	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES		155. 17	2, 094	231, 851	情報技術
PPL CORP		59	159	17, 677	公益事業
PULTEGROUP INC		19	58	6, 476	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC		20. 12	209	23, 150	素材
NORTHERN TRUST CORP		20. 62	220	24, 408	金融
NVIDIA CORP		50. 59	1, 350	149, 450	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP		6	97	10, 775	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP		41. 75	592	65, 542	金融
QURATE RETAIL INC		42. 88	91	10, 180	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC		12	51	5, 749	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A		24. 5	173	19, 250	生活必需品
NETFLIX INC		37. 86	1, 487	164, 626	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		35. 75	774	85, 684	ヘルスケア
TORCHMARK CORP		12. 15	102	11, 322	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA		13	130	14, 397	金融
TEXTRON INC		22. 1	149	16, 508	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A		88. 5	394	43, 666	一般消費財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B		32	142	15, 732	一般消費財・サービス
NEWS CORP - CLASS A		29	46	5, 141	一般消費財・サービス
OGE ENERGY CORP		12	41	4, 590	公益事業
OMNICOM GROUP		18. 5	139	15, 432	一般消費財・サービス
ORACLE CORP		263. 57	1, 209	133, 899	情報技術
MASTERCARD INC - A		80. 11	1, 596	176, 719	情報技術
ONEOK INC		37. 36	259	28, 672	エネルギー
CENTURYLINK INC		74. 49	134	14, 848	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC		9	254	28, 211	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC		25. 24	210	23, 292	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE		8	97	10, 788	情報技術
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP		4	90	10, 026	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B		17. 75	118	13, 107	生活必需品
NOBLE ENERGY INC		37. 5	129	14, 348	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP		850. 9	2, 510	277, 823	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		14. 97	134	14, 908	ヘルスケア
NORDSTROM INC		8	39	4, 415	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
AMERICAN EXPRESS CO		65.84	656	72,696	金融
ANALOG DEVICES INC		33.36	339	37,550	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES		95.45	155	17,167	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP		23.94	143	15,895	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP		74.69	409	45,301	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP		51.05	362	40,139	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC		15.69	159	17,707	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		13.68	155	17,185	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO		12	35	3,878	エネルギー
AVERY DENNISON CORP		6.5	69	7,645	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A		53.53	420	46,538	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO		56.56	412	45,635	資本財・サービス
AON PLC		22.96	321	35,630	金融
AMGEN INC		57.98	1,077	119,225	ヘルスケア
TAPESTRY INC		25.5	116	12,850	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC		34.89	276	30,614	資本財・サービス
CELGENE CORP		70.24	550	60,941	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A		15.06	349	38,700	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC		91.64	455	50,399	情報技術
CIT GROUP INC		9	46	5,114	金融
CIMAREX ENERGY CO		8	69	7,663	エネルギー
CME GROUP INC		30.41	513	56,834	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC		33.89	142	15,813	エネルギー
ECOLAB INC		23.64	343	38,043	素材
EQUIFAX INC		8.5	106	11,791	資本財・サービス
GAP INC/THE		28.2	88	9,778	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC		110.64	787	87,127	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC		14.76	178	19,706	生活必需品
HORMEL FOODS CORP		22	79	8,792	生活必需品
STATE STREET CORP		30	294	32,626	金融
SUNTRUST BANKS INC		39.22	270	29,904	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP		105.06	594	65,826	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC		45.41	342	37,900	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO		13	47	5,253	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC		8	35	3,981	素材
CARDINAL HEALTH INC		24.5	133	14,811	ヘルスケア
FEDEX CORP		22.83	601	66,576	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		40.54	390	43,200	金融
FMC CORP		11.42	103	11,413	素材
FLEX LTD		45	63	6,977	情報技術
CERNER CORP		23.68	144	16,008	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		6.5	80	8,957	素材
CITRIX SYSTEMS INC		13.5	144	15,960	情報技術
INTEL CORP		401.99	2,232	247,109	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC		28	66	7,307	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		28.5	151	16,743	金融
ILLINOIS TOOL WORKS		25	372	41,197	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC		153	112	12,497	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC		13.07	379	41,974	ヘルスケア
SEALED AIR CORP		14.5	63	7,072	素材
INTUITIVE SURGICAL INC		9.27	459	50,840	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	12.36	123	13,671	情報技術
SNAP-ON INC	5	79	8,825	資本財・サービス
CARMAX INC	19.9	145	16,126	一般消費財・サービス
COMERICA INC	14.76	140	15,548	金融
INGREDION INC	5.3	59	6,636	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	60.64	445	49,303	公益事業
TARGET CORP	42	324	35,896	一般消費財・サービス
DOVER CORP	12	91	10,101	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	4	126	14,051	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11.16	72	8,071	資本財・サービス
CINTAS CORP	7.63	146	16,177	資本財・サービス
CA INC	22	81	9,023	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	34.42	131	14,552	生活必需品
CLOROX COMPANY	12.78	163	18,089	生活必需品
ENTERGY CORP	16	122	13,584	公益事業
MICROSOFT CORP	626.72	6,356	703,503	情報技術
INCYTE CORP	14.47	106	11,793	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	87.67	605	67,069	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	116.31	1,006	111,443	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	97.83	578	64,079	情報技術
BLACKROCK INC	10.57	553	61,227	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	29	75	8,403	公益事業
HASBRO INC	10	91	10,139	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	26.2	174	19,312	生活必需品
KEYCORP	87.73	180	19,934	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	7.5	81	9,019	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	133.02	537	59,479	生活必需品
KOHL'S CORP	16.5	120	13,382	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	3.5	82	9,109	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	48.28	55	6,166	金融
APACHE CORP	36.73	157	17,435	エネルギー
CHUBB LTD	39.01	507	56,172	金融
ARROW ELECTRONICS INC	10	79	8,754	情報技術
ALLSTATE CORP	29.1	270	29,888	金融
EBAY INC	90.53	353	39,077	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC	96.73	828	91,654	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	12.83	138	15,326	素材
XILINX INC	22	154	17,149	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	48.32	397	43,982	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP-A	15	51	5,657	一般消費財・サービス
ZIONS BANCORPORATION	19	105	11,660	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	20.44	319	35,375	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	12	46	5,186	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	22	77	8,619	情報技術
LENNAR CORP-A	22.6	119	13,274	一般消費財・サービス
LEAR CORP	6	121	13,460	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	23	149	16,505	金融
PROGRESSIVE CORP	50.67	313	34,708	金融
PRAXAIR INC	26.34	425	47,096	素材
PACCAR INC	27.8	177	19,618	資本財・サービス
PVH CORP	5.5	88	9,754	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2018年6月15日現在		業種等	
		株数	評価額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
BIOGEN INC		18.99	580	64,248	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC		7.42	167	18,566	ヘルスケア
STARBUCKS CORP		124.84	711	78,786	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC		9	67	7,453	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY		24	129	14,341	公益事業
INTUIT INC		20.97	438	48,526	情報技術
BORGWARNER INC		15.5	75	8,375	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC		23	168	18,664	一般消費財・サービス
BALL CORP		28.92	106	11,804	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP		115.5	375	41,559	ヘルスケア
XL GROUP LTD		18.5	103	11,507	金融
ELECTRONIC ARTS INC		25.74	371	41,135	情報技術
VULCAN MATERIALS CO		10.5	138	15,323	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		23.03	356	39,506	ヘルスケア
VF CORP		32.04	269	29,798	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING		28.41	156	17,332	一般消費財・サービス
VIACOM INC-CLASS B		30.71	88	9,826	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC		4.8	102	11,374	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		10.03	123	13,688	ヘルスケア
CARNIVAL CORP		38.14	244	27,100	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A		406.32	1,374	152,093	一般消費財・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		21	77	8,599	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		22	138	15,276	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD		56	49	5,485	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		110	81	9,009	不動産
アメリカ・ドル通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	26,316.24 600銘柄	209,775 <64.3%>	
		百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)					
IMPERIAL OIL LTD		23	99	8,371	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		1.5	157	13,281	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		24.38	63	5,394	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN		21.21	167	14,092	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		42	122	10,328	素材
INTACT FINANCIAL CORP		10	95	8,019	金融
BCE INC		9	48	4,121	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP		16	146	12,317	素材
SUNCOR ENERGY INC		129.12	673	56,773	エネルギー
METRO INC		16	70	5,928	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA		33	210	17,746	金融
BANK OF NOVA SCOTIA		99	752	63,433	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		38	437	36,916	金融
TORONTO-DOMINION BANK		151	1,150	97,031	金融
GREAT-WEST LIFECO INC		17	56	4,781	金融
ROYAL BANK OF CANADA		120	1,198	101,044	金融
TOURMALINE OIL CORP		13	31	2,644	エネルギー
VERMILION ENERGY INC		14	64	5,413	エネルギー
TRANSCANADA CORP		76	414	34,948	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		37.71	170	14,389	エネルギー
BOMBARDIER INC-B		192	93	7,917	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP		83	143	12,073	素材
CAE INC		23	63	5,331	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP		20.2	108	9,152	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千カナダ・ドル	千円	
EMPIRE CO LTD 'A'		18	44	3,728	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD		6	51	4,358	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B		10	66	5,567	素材
LINAMAR CORP		6	38	3,224	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A		11	16	1,373	エネルギー
HYDRO ONE LTD		15	29	2,467	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD		14.89	97	8,259	生活必需品
WSP GLOBAL INC		12	88	7,471	資本財・サービス
EMERA INC		12	48	4,071	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A		10	31	2,650	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		30	185	15,670	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD		18	109	9,253	素材
KINROSS GOLD CORP		105.34	52	4,415	素材
BANK OF MONTREAL		51	519	43,799	金融
POWER CORP OF CANADA		31	94	8,007	金融
METHANEX CORP		6	53	4,532	素材
SHOPIFY INC - CLASS A		8	176	14,856	情報技術
NUTRIEN LTD		51.27	360	30,399	素材
CAMECO CORP		28	44	3,742	エネルギー
TELUS CORP		3	13	1,169	電気通信サービス
POWER FINANCIAL CORP		20	64	5,440	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B		44	164	13,888	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		5	86	7,297	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		80	30	2,529	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES		91	382	32,223	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		2	152	12,820	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC		31	265	22,414	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD		7	72	6,134	生活必需品
BLACKBERRY LTD		64	102	8,635	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC		52	284	23,995	金融
ENBRIDGE INC		143	610	51,480	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		66	363	30,628	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP		160	397	33,556	金融
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE		20	70	5,914	ヘルスケア
GOLDCORP INC		63	118	9,956	素材
ENCANA CORP		69	114	9,659	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		12	305	25,746	資本財・サービス
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC		11	57	4,870	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC		14	52	4,468	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO		64	700	59,060	資本財・サービス
CGI GROUP INC - CLASS A		19	154	13,042	情報技術
HUSKY ENERGY INC		30.12	59	5,021	エネルギー
ONEX CORPORATION		7	64	5,473	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		39	107	9,097	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC		25	84	7,155	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC		19	113	9,551	資本財・サービス
IGM FINANCIAL INC		3	11	1,005	金融
OPEN TEXT CORP		27	127	10,724	情報技術
CI FINANCIAL CORP		20	49	4,209	金融
SAPUTO INC		13	56	4,772	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		63	138	11,661	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		30	164	13,861	生活必需品
FORTIS INC		42	170	14,379	公益事業

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2018年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千カナダ・ドル	千円	
LUNDIN MINING CORP		66	55	4,647	素材
CRESCENT POINT ENERGY CORP		25	24	2,061	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC		80	99	8,352	エネルギー
DOLLARAMA INC		9	136	11,514	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I		8	31	2,645	公益事業
ALTAGAS LTD		8	20	1,764	エネルギー
FIRST CAPITAL REALTY INC		20	42	3,555	不動産
KEYERA CORP		22	79	6,693	エネルギー
INTER PIPELINE LTD		48	117	9,941	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		28	36	3,119	エネルギー
カナダ・ドル通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	3,324.74 87銘柄	15,005 1,265,448	<3.5%>
		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
(オーストラリア)					
HEALTHSCOPE LTD		160	36	3,023	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD		228.24	66	5,462	金融
BHP BILLITON LIMITED		256.32	855	70,612	素材
SOUTH32 LTD		362.13	137	11,386	素材
ALUMINA LTD		121	33	2,736	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		77.28	260	21,506	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		105	48	4,029	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		36	36	3,021	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		223.99	581	47,970	金融
WESTPAC BANKING CORP		268.2	732	60,427	金融
SANTOS LTD		182.7	106	8,775	エネルギー
AUSNET SERVICES		285	44	3,657	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP		248.74	651	53,784	金融
RIO TINTO LTD		39.49	334	27,578	素材
ORIGIN ENERGY LTD		120.5	116	9,646	エネルギー
AMCOR LIMITED		109.96	151	12,514	素材
AURIZON HOLDINGS LTD		153.1	66	5,458	資本財・サービス
OIL SEARCH LTD		154.18	129	10,663	エネルギー
SEEK LTD		26	55	4,542	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		55.92	98	8,099	生活必需品
NEWCREST MINING LTD		58.04	118	9,819	素材
INCITEC PIVOT LTD		204	70	5,808	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		145	978	80,716	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD		20	60	5,004	エネルギー
ORICA LTD		20	34	2,870	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		150.22	139	11,529	金融
CIMIC GROUP LTD		10	40	3,339	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD		117.6	340	28,126	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD		26	23	1,903	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD		173.52	79	6,573	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD		30	39	3,280	一般消費財・サービス
TELSTRA CORP LTD		351.14	101	8,404	電気通信サービス
AMP LTD		249.35	90	7,470	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		32	69	5,717	素材
MACQUARIE GROUP LTD		25.42	288	23,800	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		40.35	119	9,857	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD		30	29	2,453	金融
CSL LTD		37.29	696	57,485	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2018年 6月15日現在		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額
		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
WESFARMERS LTD		95. 67	449	37, 109	生活必需品
COCHLEAR LTD		4. 44	84	6, 954	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD		32. 12	58	4, 864	素材
SUNCORP GROUP LTD		99. 38	137	11, 375	金融
BORAL LTD		86	54	4, 499	素材
ASX LTD		13	80	6, 646	金融
COMPUTERSHARE LTD		37	66	5, 456	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		175. 18	139	11, 479	金融
SONIC HEALTHCARE LTD		25	59	4, 931	ヘルスケア
CHALLENGER LTD		63	77	6, 431	金融
AGL ENERGY LTD		70. 39	150	12, 455	公益事業
BRAMBLES LTD		113. 37	102	8, 448	資本財・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L		8	50	4, 130	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD		9	52	4, 291	ヘルスケア
REA GROUP LTD		6. 08	54	4, 521	情報技術
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		6. 21	31	2, 635	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計		株 数、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	5, 777. 52 54 銘柄	9, 515 <2. 2%>	
(香港)		百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		145	801	11, 306	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		220	1, 426	20, 116	一般消費財・サービス
MTR CORP		75	327	4, 610	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES		120	1, 478	20, 845	不動産
SINO LAND CO		340	454	6, 404	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		225. 52	1, 991	28, 077	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD		80	204	2, 876	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		35	290	4, 096	不動産
CLP HOLDINGS LTD		135	1, 096	15, 465	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		105. 14	463	6, 530	不動産
HANG LUNG GROUP LTD		80	189	2, 667	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		793. 05	1, 178	16, 616	公益事業
HANG SENG BANK LTD		64	1, 266	17, 858	金融
WHELOCK & CO LTD		60	345	4, 877	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT		580	687	9, 699	不動産
WH GROUP LTD		915	636	8, 979	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		100	2, 556	36, 039	金融
MINTH GROUP LTD		60	222	3, 142	一般消費財・サービス
LI & FUNG LTD		700	210	2, 970	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD		120	207	2, 927	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		20	211	2, 986	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		80	186	2, 622	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD		150	218	3, 083	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD		75	321	4, 531	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		86	275	3, 880	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO		60	268	3, 785	不動産
SJM HOLDINGS LTD		100	103	1, 457	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		80	246	3, 479	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		230. 52	1, 513	21, 338	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		55	325	4, 583	公益事業
PCCW LTD		600	269	3, 798	電気通信サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2018年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千香港ドル	千円	
AIA GROUP LTD		1,076	7,548	106,428	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		140	832	11,735	不動産
SANDS CHINA LTD		230	1,040	14,674	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD		40	66	940	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		120	567	7,994	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD		140	296	4,175	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		290	1,154	16,274	金融
WYNN MACAU LTD		168	475	6,703	一般消費財・サービス
香港ドル通貨計	株数、金額 銘柄数＜比率＞	8,693.23 39銘柄	31,956	450,584 ＜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		108	291	23,925	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD		145	400	32,908	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD		71	79	6,530	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD		173	125	10,295	資本財・サービス
UOL GROUP LTD		52	39	3,278	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		52	58	4,791	不動産
CAPITALAND LTD		190	64	5,294	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING		270	26	2,141	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		120	31	2,594	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		9	29	2,452	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		258	312	25,724	金融
GENTING SINGAPORE LTD		450	54	4,512	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD		32	64	5,289	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		654	208	17,149	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING		141	48	3,998	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		40	11	920	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		90	2	236	生活必需品
SATS LTD		77	38	3,177	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD		69	49	4,089	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD		100	23	1,907	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD		158	51	4,259	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数＜比率＞	3,259 21銘柄	2,013	165,478 ＜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	47	3,634	公益事業
A2 MILK CO LTD		70	80	6,192	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD		168.6	64	4,928	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		81	56	4,318	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		23.26	15	1,207	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		37	55	4,272	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD		44.19	53	4,079	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数＜比率＞	574.05 7銘柄	372	28,634 ＜0.1%＞	
(イギリス)		百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT		50	19	2,807	一般消費財・サービス
TUI AG-DI		48.02	84	12,426	一般消費財・サービス
BP PLC		1,739.3	1,018	149,352	エネルギー
UNILEVER PLC		101.99	411	60,332	生活必需品

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
BARCLAYS PLC		1,505.91	302	44,303	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		140.34	123	18,170	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC		105	32	4,727	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD		10.12	60	8,822	素材
PRUDENTIAL PLC		225.06	419	61,542	金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP		345.42	91	13,353	金融
JOHNSON MATTHEY PLC		17.58	67	9,856	素材
BAE SYSTEMS PLC		293.37	190	28,001	資本財・サービス
AVIVA PLC		327.89	169	24,861	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC		420.6	664	97,474	ヘルスケア
MICRO FOCUS INTERNATIONAL		31.33	42	6,283	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC		400	96	14,108	資本財・サービス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC		29	16	2,399	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC		133.52	56	8,265	情報技術
DCC PLC		9.38	68	9,973	資本財・サービス
GVC HOLDINGS PLC		41.61	43	6,316	一般消費財・サービス
CONVATEC GROUP PLC		65.81	14	2,199	ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC		100.76	50	7,465	資本財・サービス
NMC HEALTH PLC		9.75	35	5,267	ヘルスケア
RELX PLC		83.81	134	19,783	資本財・サービス
DIAGEO PLC		208.95	579	84,992	生活必需品
RIO TINTO PLC		105.82	465	68,317	素材
STANDARD CHARTERED PLC		297.45	217	31,884	金融
TESCO PLC		887.48	221	32,513	生活必需品
FRESNILLO PLC		24	28	4,244	素材
SMITH & NEPHEW PLC		83.29	113	16,643	ヘルスケア
GLENCORE PLC		1,067.03	425	62,361	素材
WOOD GROUP (JOHN) PLC		54.66	35	5,146	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC		15	31	4,593	金融
SMITHS GROUP PLC		40.8	73	10,776	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC		6	5	753	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		109.63	39	5,736	金融
PEARSON PLC		82.71	73	10,713	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC		176.31	55	8,137	生活必需品
NEXT PLC		11.59	71	10,528	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC		322.36	60	8,892	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC		17.85	74	10,919	一般消費財・サービス
BUNZL PLC		31.59	74	10,887	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC		2,227.53	418	61,437	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		8.03	39	5,842	素材
KINGFISHER PLC		172.29	54	7,946	一般消費財・サービス
WPP PLC		99.21	122	17,896	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC		82.44	64	9,505	公益事業
SEVERN TRENT PLC		13	24	3,584	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		58.55	360	52,809	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC		48.83	60	8,883	金融
SCHRODERS PLC		12.27	40	5,895	金融
SSE PLC		82.82	112	16,519	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE		13	26	3,946	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		123.68	69	10,194	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC		104.35	568	83,376	ヘルスケア
FERGUSON PLC		19.89	121	17,875	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		496.81	135	19,905	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
3I GROUP PLC		84.39	82	12,124	金融
SKY PLC		86.77	117	17,179	一般消費財・サービス
ASHTHEAD GROUP PLC		39	92	13,635	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE		97.25	66	9,704	情報技術
NATIONAL GRID PLC		303.25	253	37,105	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC		5,963.72	376	55,215	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC		63.8	41	6,156	金融
IMPERIAL BRANDS PLC		82.23	214	31,452	生活必需品
CENTRICA PLC		380.02	58	8,541	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		7	29	4,310	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		192.39	718	105,372	生活必需品
BHP BILLITON PLC		178.2	311	45,704	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		29.6	81	11,942	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		1,669.22	1,226	179,835	金融
SHIRE PLC		82.23	334	49,077	ヘルスケア
OLD MUTUAL PLC		414.79	94	13,803	金融
ANGLO AMERICAN PLC		107.45	192	28,261	素材
MONDI PLC		34	70	10,406	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS		145	35	5,235	生活必需品
CARNIVAL PLC		13.83	66	9,683	一般消費財・サービス
EASYJET PLC		16.44	29	4,330	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC		142.39	229	33,725	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC		25.69	70	10,274	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC		656.24	140	20,605	電気通信サービス
COCA-COLA HBC AG-DI		12	31	4,628	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC		33	71	10,468	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		13.72	67	9,948	一般消費財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC		17	24	3,569	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC		15.92	92	13,612	資本財・サービス
ITV PLC		275.87	48	7,066	一般消費財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		27.35	122	18,010	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		402.7	1,050	153,998	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		323.53	876	128,610	エネルギー
MEGGITT PLC		99.25	49	7,301	資本財・サービス
G4S PLC		113.2	31	4,640	資本財・サービス
ADMIRAL GROUP PLC		15.7	29	4,393	金融
INVESTEC PLC		46	26	3,852	金融
ANTOFAGASTA PLC		34.6	36	5,404	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		204.57	72	10,596	金融
EXPERIAN PLC		75.55	142	20,852	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株 数、金 額	25,865.65	16,789	2,462,397	
	銘 柄 数 < 比 率 >	97 銘柄		<6.8%>	
(イスラエル)		百株	千イスラエル・シェケル	千円	
AZRIELI GROUP LTD		5.3	97	2,992	不動産
FRUTAROM		4.18	147	4,507	素材
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		50	20	612	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD		110.96	197	6,047	素材
ELBIT SYSTEMS LTD		3	133	4,082	資本財・サービス
BANK HAPOLALIM BM		79	197	6,032	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL		114	253	7,752	金融
NICE LTD		8	317	9,724	情報技術
イスラエル・シェケル通貨計	株 数、金 額	374.44	1,363	41,753	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8 銘柄		<0.1%>	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
DUFREY AG-REG		1.89	26	2,927	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG		324.02	510	56,641	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		0.5	32	3,643	素材
ADECCO GROUP AG-REG		17.54	106	11,836	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		58.77	1,241	137,741	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR		3.89	35	3,896	金融
SIKA AG-REG		11.4	166	18,499	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.01	75	8,385	生活必需品
ABB LTD-REG		146.76	342	38,043	資本財・サービス
SWISS RE AG		25	222	24,690	金融
NESTLE SA-REG		256.66	1,915	212,433	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG		1.63	121	13,433	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		3	66	7,387	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		215.08	336	37,323	金融
JULIUS BAER GROUP LTD		21.98	134	14,940	金融
SGS SA-REG		0.46	122	13,597	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		1.53	33	3,696	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG		3.69	60	6,665	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG		5.08	78	8,694	情報技術
SWATCH GROUP AG/THE-BR		2.67	132	14,751	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		11.63	349	38,751	金融
BALOISE HOLDING AG - REG		3.2	47	5,313	金融
CLARIANT AG-REG		15.68	38	4,311	素材
NOVARTIS AG-REG		186.7	1,409	156,351	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.2	36	4,024	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG		44.47	411	45,646	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG		2.76	123	13,653	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG		3.34	147	16,367	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG		0.68	153	17,046	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG		1.11	85	9,461	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG		5.63	97	10,865	ヘルスケア
LONZA GROUP AG-REG		5.42	149	16,532	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG		4.5	40	4,517	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		38.01	198	22,016	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		2.31	81	9,031	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		4.95	76	8,436	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG		9.46	87	9,700	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.1	63	7,032	生活必需品
ス イ ス ・ フ ラ ン 通 貨 計		株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,441.71 38 銘柄	9,360 <2.9%>	
(デンマーク)					
		百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B		165.16	4,721	81,075	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S		72.36	1,585	27,221	金融
ISS A/S		13.2	293	5,040	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A		0.3	278	4,777	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S		5	229	3,943	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		18.57	769	13,206	資本財・サービス
CARLSBERG AS-B		8.06	596	10,235	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES		18.02	591	10,151	素材
COLOPLAST-B		10.52	671	11,534	ヘルスケア
DSV A/S		16.5	894	15,360	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘 柄		2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千デンマーク・クローネ	千円	
WILLIAM DEMANT HOLDING		13. 14	339	5, 829	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		0. 66	655	11, 255	資本財・サービス
TRYG A/S		17	256	4, 395	金融
PANDORA A/S		7. 5	366	6, 291	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		7. 5	489	8, 398	素材
GENMAB A/S		4. 33	427	7, 343	ヘルスケア
ORSTED A/S		15. 33	574	9, 867	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株 数 、 金 額	393. 15	13, 740	235, 931	
	銘 柄 数 < 比 率 >	17 銘柄		<0. 7%>	
(ノルウェー)		百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA		130. 5	692	9, 424	素材
DNB ASA		85. 45	1, 355	18, 431	金融
ORKLA ASA		70	512	6, 964	生活必需品
TELENOR ASA		62. 5	1, 066	14, 509	電気通信サービス
EQUINOR ASA		91. 44	2, 000	27, 209	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		14. 5	502	6, 829	素材
MARINE HARVEST		23. 5	402	5, 474	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		20	258	3, 519	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS		17	417	5, 675	一般消費財・サービス
AKER BP ASA		13. 06	397	5, 410	エネルギー
ノルウェー・クローネ通貨計	株 数 、 金 額	527. 95	7, 606	103, 448	
	銘 柄 数 < 比 率 >	10 銘柄		<0. 3%>	
(スウェーデン)		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB		7	191	2, 424	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS		263. 83	1, 798	22, 736	情報技術
VOLVO AB-B SHS		145. 68	2, 183	27, 593	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		7. 77	427	5, 401	電気通信サービス
SKF AB-B SHARES		40	689	8, 711	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B		26	568	7, 180	一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB		265. 29	2, 271	28, 710	金融
SWEDISH MATCH AB		12	509	6, 435	生活必需品
TELE2 AB-B SHS		32. 58	378	4, 779	電気通信サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		131	1, 088	13, 753	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		125. 26	1, 238	15, 655	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		90. 75	1, 722	21, 771	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		90. 39	1, 266	16, 002	一般消費財・サービス
SKANSKA AB-B SHS		37. 09	594	7, 512	資本財・サービス
SANDVIK AB		101. 22	1, 585	20, 035	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		33. 82	1, 263	15, 975	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		69. 82	1, 947	24, 618	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS		25	363	4, 594	資本財・サービス
TELIA CO AB		241. 07	1, 035	13, 084	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB		20	449	5, 675	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		25	634	8, 013	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		84. 01	1, 605	20, 287	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS		9. 48	270	3, 422	金融
LUNDIN PETROLEUM AB		19	539	6, 815	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B		50. 5	1, 087	13, 749	生活必需品
BOLIDEN AB		31. 71	968	12, 246	素材
EPIROC AB-A		69. 82	585	7, 399	その他
EPIROC AB-B		25	201	2, 545	その他
HUSQVARNA AB-B SHS		24	211	2, 668	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B		15	475	6, 012	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2018年6月15日現在			業 種 等
		株 数	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
HEXAGON AB-B SHS		百株 24	千スウェーデン・クローネ 1,235	千円 15,616	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		13	240	3,036	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,156.09 32 銘柄	29,625	374,468 <1.0%>	
ユーロ (アイルランド)		百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		19.95	69	8,859	素材
AIB GROUP PLC		90	44	5,709	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC		102.34	72	9,227	金融
KERRY GROUP PLC-A		12.66	113	14,467	生活必需品
CRH PLC		65	212	27,118	素材
PADDY POWER BETFAIR PLC		8.89	87	11,142	一般消費財・サービス
国 小 計	株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	298.84 6 銘柄	598	76,525 <0.2%>	
ユーロ (オランダ)		百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N. V.		25.21	81	10,385	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		81.13	299	38,346	ヘルスケア
NN GROUP NV		31	114	14,626	金融
UNILEVER NV-CVA		127.32	594	75,982	生活必需品
HEINEKEN NV		22.15	194	24,935	生活必需品
RELX NV		82	149	19,155	資本財・サービス
AEGON NV		143.61	77	9,973	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		106.52	217	27,840	生活必需品
AKZO NOBEL		21.18	161	20,685	素材
KONINKLIJKE DSM NV		19.38	174	22,352	素材
WOLTERS KLUWER		23.76	114	14,635	資本財・サービス
ING GROEP NV		308.53	392	50,202	金融
KONINKLIJKE KPN NV		360	86	11,101	電気通信サービス
ASML HOLDING NV		32.31	599	76,698	情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA		34.53	79	10,166	金融
VOPAK		6.3	26	3,360	エネルギー
RANDSTAD NV		7.5	40	5,128	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		11	93	11,958	生活必需品
AIRBUS SE		47.04	491	62,907	資本財・サービス
EXOR NV		10.88	67	8,602	金融
CNH INDUSTRIAL NV		73.53	74	9,522	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		107.87	196	25,162	一般消費財・サービス
FERRARI NV		11.3	143	18,383	一般消費財・サービス
国 小 計	株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,694.05 23 銘柄	4,473	572,113 <1.6%>	
ユーロ (ベルギー)		百株	千ユーロ	千円	
UCB SA		11.1	73	9,426	ヘルスケア
KBC GROUP NV		22.11	148	18,929	金融
COLRUYT SA		3.5	16	2,057	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		9	84	10,808	金融
SOLVAY SA		8.73	98	12,661	素材
UMICORE		16	81	10,436	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		60.89	511	65,441	生活必需品
AGEAS		16.54	73	9,344	金融
PROXIMUS		22.69	49	6,317	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		4.62	19	2,448	一般消費財・サービス
国 小 計	株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	175.18 10 銘柄	1,156	147,872 <0.4%>	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ルクセンブルグ)					
RTL GROUP		3.5	22	2,934	一般消費財・サービス
ARCELMITTAL		53.27	154	19,789	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		1.31	54	7,020	ヘルスケア
SES		44.02	68	8,785	一般消費財・サービス
TENARIS SA		47	74	9,479	エネルギー
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	149.1	375	48,009	
		5 銘柄		<0.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フランス)					
JCDECAUX SA		8.45	23	3,019	一般消費財・サービス
TOTAL SA		199.22	1,053	134,688	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		14.28	157	20,181	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		34.38	385	49,292	素材
KERING		6.12	314	40,280	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		42.86	324	41,497	資本財・サービス
BOUYGUES SA		18.92	73	9,406	資本財・サービス
BNP PARIBAS		95.82	525	67,208	金融
PEUGEOT SA		45.73	97	12,469	一般消費財・サービス
NATIXIS		76.74	49	6,271	金融
THALES SA		9.18	101	12,997	資本財・サービス
DANONE		49.32	320	40,995	生活必需品
CARREFOUR SA		51.56	80	10,241	生活必需品
SUEZ		29.5	34	4,357	公益事業
VIVENDI		88.01	192	24,651	一般消費財・サービス
L'OREAL		20.56	434	55,511	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		40.13	166	21,302	資本財・サービス
LEGRAND SA		22.5	146	18,693	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		2	6	877	生活必需品
PERNOD RICARD SA		18.08	261	33,507	生活必需品
SOCIETE BIC SA		1.5	11	1,532	資本財・サービス
EURAZEO SA		5.34	35	4,586	金融
REXEL SA		38.7	51	6,612	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA		61.29	229	29,364	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		23.11	699	89,426	一般消費財・サービス
ACCOR SA		18.5	82	10,567	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		16.45	194	24,826	情報技術
VALEO SA		19.65	104	13,405	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		18.06	107	13,716	一般消費財・サービス
BUREAU VERITAS SA		32.27	75	9,649	資本財・サービス
EIFFAGE		7.5	72	9,243	資本財・サービス
SODEXO SA		6.69	57	7,334	一般消費財・サービス
IPSEN		2.76	37	4,839	ヘルスケア
INGENICO GROUP		4.99	38	4,881	情報技術
AMUNDI SA		4.37	27	3,537	金融
TELEPERFORMANCE		5	69	8,940	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		5	49	6,378	情報技術
FAURECIA		5.6	40	5,158	一般消費財・サービス
SEB SA		1.97	30	3,847	一般消費財・サービス
ESSILOR INTERNATIONAL		14.86	180	23,025	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA		0.22	37	4,794	資本財・サービス
AXA SA		157.75	344	44,054	金融
EDENRED		19.13	52	6,711	資本財・サービス
RENAULT SA		16.5	139	17,902	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千ユーロ	千円	
HERMES INTERNATIONAL		2. 68	147	18, 900	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		2. 53	32	4, 093	生活必需品
ATOS SE		9. 46	116	14, 912	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA		11. 49	142	18, 215	情報技術
WENDEL		2. 01	25	3, 223	金融
ORANGE		174. 04	254	32, 588	電気通信サービス
ALSTOM		13. 1	52	6, 745	資本財・サービス
CNP ASSURANCES		13. 49	26	3, 411	金融
SANOFI		92. 52	622	79, 673	ヘルスケア
VINCI SA		39. 22	336	43, 039	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		38. 63	75	9, 639	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		99. 04	119	15, 263	金融
BIOMERIEUX		4. 57	37	4, 787	ヘルスケア
ENGIE		144. 44	200	25, 669	公益事業
IMERYS SA		3. 4	24	3, 104	素材
EDF		67. 6	78	9, 986	公益事業
SAFRAN SA		25. 92	269	34, 527	資本財・サービス
ILIAD SA		2. 19	31	3, 976	電気通信サービス
ARKEMA		8. 38	87	11, 136	素材
ADP		3. 5	68	8, 711	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		14	24	3, 169	一般消費財・サービス
SCOR SE		12. 97	41	5, 361	金融
GETLINK		39. 4	48	6, 142	資本財・サービス
BOLLORE		73	30	3, 891	資本財・サービス
国 小 計		株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2, 258. 15 68 銘柄	10, 414 <3. 7%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ドイツ)					
BAYER AG-REG		68. 61	691	88, 454	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		18	55	7, 132	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		156. 95	151	19, 385	金融
COMMERZBANK AG		96. 89	90	11, 521	金融
VOLKSWAGEN AG		4. 2	68	8, 756	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		13. 72	224	28, 662	一般消費財・サービス
MAN SE		1	9	1, 191	資本財・サービス
SIEMENS AG-REG		60. 87	734	93, 968	資本財・サービス
E. ON SE		162. 7	150	19, 294	公益事業
UNIPER SE		13. 8	35	4, 514	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		29. 21	251	32, 230	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		13	41	5, 325	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG		6. 45	33	4, 281	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		9	198	25, 381	一般消費財・サービス
BASF SE		73. 57	647	82, 870	素材
K+S AG-REG		14	32	4, 104	素材
ALLIANZ SE-REG		35. 81	655	83, 843	金融
THYSSENKRUPP AG		40. 3	95	12, 210	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		18. 57	204	26, 149	生活必需品
RWE AG		53. 09	106	13, 621	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		17	40	5, 183	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		5. 6	47	6, 088	資本財・サービス
BRENNTAG AG		14. 36	72	9, 264	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		37. 09	263	33, 652	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		9. 59	55	7, 123	情報技術

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2018年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
HOCHTIEF AG		1.66	26	3,401	資本財・サービス
SAP SE		78.08	814	104,158	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		12.14	225	28,818	金融
SCHAEFFLER AG		21.02	27	3,496	一般消費財・サービス
ZALANDO SE		7	33	4,263	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		12.3	95	12,226	素材
KION GROUP AG		6	43	5,565	資本財・サービス
WIRECARD AG		10	156	19,990	情報技術
COVESTRO AG		19.45	150	19,304	素材
INNOGY SE		15	55	7,060	公益事業
SARTORIUS AG-VORZUG		3.05	40	5,188	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		12.65	79	10,212	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO AG		10.56	43	5,537	情報技術
METRO AG		15	17	2,187	生活必需品
1&1 DRILLISCH AG		5	32	4,121	電気通信サービス
LINDE AG - TENDER		16.27	340	43,533	素材
SIEMENS HEALTHINEERS AG		15	53	6,884	ヘルスケア
BEIERSDORF AG		8.15	80	10,357	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF		7	32	4,154	素材
MERCK KGAA		11.49	96	12,364	ヘルスケア
ADIDAS AG		15.92	316	40,468	一般消費財・サービス
PUMA SE		0.51	25	3,294	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		6.5	63	8,176	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		289.91	401	51,355	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		17.66	156	19,985	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		80.1	506	64,736	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		97.73	249	31,861	情報技術
HANNOVER RUECK SE		6.44	72	9,216	金融
DEUTSCHE POST AG-REG		75.48	229	29,309	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		18.97	220	28,241	金融
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE		15.6	37	4,838	一般消費財・サービス
LANXESS AG		6	43	5,545	素材
MTU AERO ENGINES AG		4	66	8,523	資本財・サービス
AXEL SPRINGER SE		4.7	28	3,702	一般消費財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE		32.85	135	17,339	不動産
SYMRISE AG		14.36	107	13,800	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		62.4	22	2,930	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		2.5	18	2,380	一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD		8.11	64	8,300	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		44.35	184	23,540	不動産
国小計		株数、金額 銘柄数<比率>	2,064.29 65銘柄	10,356 <3.7%>	
ユーロ（ポルトガル）		百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS		29	38	4,959	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		151	51	6,566	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		36.09	58	7,468	エネルギー
国小計		株数、金額 銘柄数<比率>	216.09 3銘柄	148 <0.1%>	
ユーロ（スペイン）		百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA		405.69	306	39,170	電気通信サービス
ENDESA SA		21.5	41	5,363	公益事業

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2018年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		523.05	318	40,767	金融
IBERDROLA SA		468.86	312	39,938	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		496.34	72	9,325	金融
BANKINTER SA		67	58	7,436	金融
REPSOL SA		102.13	175	22,493	エネルギー
GRIFOLS SA		30.04	82	10,608	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		1,298.09	621	79,468	金融
AMADEUS IT GROUP SA		36.95	266	34,139	情報技術
GAS NATURAL SDG SA		21	45	5,852	公益事業
MAPFRE SA		80.05	20	2,644	金融
CAIXABANK S. A		304.87	117	15,039	金融
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		49	40	5,132	資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		21.95	80	10,331	資本財・サービス
AENA SME SA		5.69	91	11,647	資本財・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		96.55	289	37,083	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		17.93	23	3,015	資本財・サービス
ENAGAS SA		36.75	90	11,525	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA		40.56	72	9,283	公益事業
FERROVIAL SA		38.76	71	9,136	資本財・サービス
BANKIA SA		159.05	53	6,892	金融
国小計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,321.81	3,254	416,295
			22銘柄		<1.2%>
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (イタリア)					
PRYSMIAN SPA		14.4	37	4,733	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		117.33	172	22,112	金融
MEDIOBANCA SPA		44.6	36	4,658	金融
UNICREDIT SPA		176.37	256	32,753	金融
TELECOM ITALIA SPA		1,085.03	74	9,492	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP		483.81	29	3,711	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO-RSP		93.84	25	3,228	金融
INTESA SANPAOLO		1,027.4	266	34,086	金融
ATLANTIA SPA		35.27	88	11,349	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		29	22	2,900	金融
MONCLER SPA		15.22	64	8,210	一般消費財・サービス
RECORDATI SPA		6.92	23	2,947	ヘルスケア
ENI SPA		211.46	334	42,770	エネルギー
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		44.83	31	3,970	生活必需品
PIRELLI & C SPA		56.51	41	5,348	一般消費財・サービス
LEONARDO SPA		25	22	2,877	資本財・サービス
ENEL SPA		711.57	346	44,349	公益事業
SNAM SPA		243	87	11,229	エネルギー
LUXOTTICA GROUP SPA		13.07	72	9,287	一般消費財・サービス
TERNA SPA		99	46	5,895	公益事業
国小計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,533.63	2,079	265,912
			20銘柄		<0.7%>
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フィンランド)					
UPM-KYMMENE OYJ		44.93	143	18,302	素材
NOKIA OYJ		439.04	229	29,413	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		41.16	72	9,241	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		41.93	74	9,516	素材
METSO OYJ		11.08	34	4,393	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘 柄		2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千ユーロ	千円	
ELISA OYJ		13	51	6,527	電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS		38.32	161	20,712	金融
FORTUM OYJ		44	89	11,424	公益事業
KONE OYJ-B		26.6	118	15,163	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ		17.7	61	7,873	一般消費財・サービス
NESTE OYJ		11	73	9,426	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		17.63	43	5,506	ヘルスケア
国 小 計	株 数 、 金 額	746.39	1,153	147,500	
	銘 柄 数 < 比 率 >	12 銘柄		<0.4%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オーストリア)					
OMV AG		12.09	61	7,821	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		27.5	99	12,764	金融
VOESTALPINE AG		8	35	4,577	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		11	30	3,939	金融
ANDRITZ AG		5.5	24	3,090	資本財・サービス
国 小 計	株 数 、 金 額	64.09	251	32,193	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5 銘柄		<0.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (その他)					
STMICROELECTRONICS NV		49.17	111	14,237	情報技術
国 小 計	株 数 、 金 額	49.17	111	14,237	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1 銘柄		<0.0%>	
ユ ー ロ 通 貨 計	株 数 、 金 額	16,570.79	34,372	4,396,201	
	銘 柄 数 < 比 率 >	240 銘柄		<12.2%>	
フ ァ ン ド 合 計	株 数 、 金 額	95,274.56	—	34,565,920	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1,250 銘柄		<95.8%>	

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

(注 2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注 3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国投資信託証券

銘 柄		2018年 6月15日現在		
		口 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)		千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC		1.072	180	19,954
SIMON PROPERTY GROUP INC		2.794	458	50,730
BOSTON PROPERTIES INC		1.15	137	15,258
GGP INC		6.391	132	14,663
VORNADO REALTY TRUST		1.156	83	9,204
SBA COMMUNICATIONS CORP		1.055	165	18,332
EQUITY RESIDENTIAL		2.85	181	20,109
EQUINIX INC		0.706	280	31,001
AMERICAN TOWER CORP		3.691	510	56,518
HOST HOTELS & RESORTS INC		6.228	132	14,703
KIMCO REALTY CORP		3.3	54	6,037
INVITATION HOMES INC		2.2	49	5,459
VENTAS INC		2.7	146	16,259
WEYERHAEUSER CO		5.858	218	24,158

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	2018年6月15日現在	
		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
AGNC INVESTMENT CORP	4.334	82	9,114
CROWN CASTLE INTL CORP	3.493	353	39,112
IRON MOUNTAIN INC	1.718	58	6,463
VEREIT INC	7.75	56	6,210
PROLOGIS INC	4.806	309	34,266
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.7	89	9,890
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.65	58	6,486
DUKE REALTY CORP	3.1	88	9,795
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.6	140	15,594
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.45	54	6,031
WELLTOWER INC	2.947	169	18,800
HCP INC	4.55	108	12,020
LIBERTY PROPERTY TRUST	1	44	4,900
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.1	106	11,793
MACERICH CO/THE	0.7	39	4,347
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	9.6	100	11,177
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1.552	65	7,243
REALTY INCOME CORP	2.55	135	14,955
PUBLIC STORAGE	1.3	278	30,857
REGENCY CENTERS CORP	1.15	69	7,638
SL GREEN REALTY CORP	0.65	63	7,038
UDR INC	1.9	70	7,801
DIGITAL REALTY TRUST INC	1.8	191	21,243
EXTRA SPACE STORAGE INC	1.285	125	13,871
ア メ リ カ ・ ド ル 通 貨 計	□ 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	100.836 38 銘柄	5,593 <1.7%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2	40	3,393
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1.4	33	2,819
カ ナ ダ ・ ド ル 通 貨 計	□ 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	3.4 2 銘柄	73 <0.0%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円
LENDLEASE GROUP	4.303	81	6,711
TRANSURBAN GROUP	17.162	204	16,883
SYDNEY AIRPORT	9.129	66	5,477
APA GROUP	7.5	72	5,948
SCENTRE GROUP	43.529	183	15,124
DEXUS	6.5	62	5,149
GPT GROUP	14.648	73	6,056
MIRVAC GROUP	31.638	70	5,822
STOCKLAND	14.3	59	4,897
GOODMAN GROUP	14.731	139	11,537
VICINITY CENTRES	19.523	51	4,253
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	182.963 11 銘柄	1,064 <0.2%>
(香港)	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT	18	1,285	18,121
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	52	387	5,462
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34	340	4,803
香 港 ド ル 通 貨 計	□ 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	104 3 銘柄	2,013 <0.1%>

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2018年6月15日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)		千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		28	45	3,774
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		30.5	79	6,568
CAPITALAND MALL TRUST		9	18	1,501
SUNTEC REIT		26	44	3,633
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	93.5	188	15,478
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.0%>
(イギリス)		千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC		4,808	45	6,724
SEGRO PLC		5.92	39	5,817
HAMMERSON PLC		10,958	58	8,604
BRITISH LAND CO PLC		6.3	43	6,393
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	27,986	187	27,540
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.1%>
(ユーロ (フランス))		千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL GROUP STAPLED		1,249	239	30,591
ICADE		0.406	33	4,268
GECINA SA		0.334	47	6,134
KLEPIERRE		2,394	79	10,220
COVIVIO		0.353	31	4,045
ユーロ通貨計	口数、金額	4,736	432	55,260
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.2%>
合計	口数、金額	517,421	—	839,789
	銘柄数<比率>	67銘柄		<2.3%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別残高（評価額）

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

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

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

運用報告書 第10期（決算日 2018年1月10日）

（計算期間 2017年1月11日～2018年1月10日）

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの第10期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

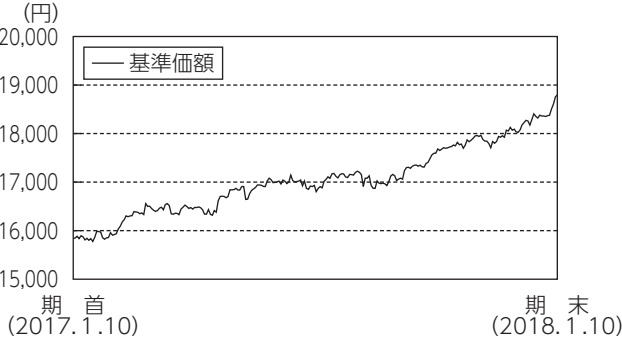
大和投資信託

Daiwa Asset Management

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

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

■当期中の基準価額と市況の推移



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

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：15,841円 期末：18,797円 騰落率：18.7%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○外国株式市況

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は16.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は18.7%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

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

(注 2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2017 年 1 月 11 日から 2018 年 1 月 10 日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 12,320.9 (71.17)	千アメリカ・ドル 85,224 (△ 717)	百株 1,269.88	千アメリカ・ドル 7,409
	カナダ	百株 1,722.5 (△ 26.7)	千カナダ・ドル 6,638 ()	百株 214.32	千カナダ・ドル 519
	オーストラリア	百株 2,524.19 (△ 364.22)	千オーストラリア・ドル 4,188 (△ 270)	百株 204.3	千オーストラリア・ドル 244
	香港	百株 5,091 (△ 101.42)	千香港ドル 13,906 (△ 331)	百株 343.44	千香港ドル 1,097
	シンガポール	百株 1,540 ()	千シンガポール・ドル 843 ()	百株 122	千シンガポール・ドル 44
	ニュージーランド	百株 206.79 ()	千ニュージーランド・ドル 115 ()	百株 —	千ニュージーランド・ドル —
	イギリス	百株 12,072.36 (△ 39.41)	千イギリス・ポンド 7,367 (△ 6)	百株 401.44	千イギリス・ポンド 237
	イスラエル	百株 120.48 ()	千イスラエル・シェケル 424 ()	百株 —	千イスラエル・シェケル —
	スイス	百株 656.26 (7.33)	千スイス・フラン 4,481 (△ 47)	百株 41.44	千スイス・フラン 714
	デンマーク	百株 254.62 ()	千デンマーク・クローネ 6,673 ()	百株 12.3	千デンマーク・クローネ 427
	ノルウェー	百株 210.62 ()	千ノルウェー・クローネ 2,600 (△ 29)	百株 —	千ノルウェー・クローネ —
	国				

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	スウェーデン	百株 873.39 (58.16)	千スウェーデン・クローネ 13,381 (△ 4)	百株 95.37	千スウェーデン・クローネ 1,338
	ユーロ (アイルランド)	百株 123.76 (△ 1,517.66)	千ユーロ 208 ()	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オランダ)	百株 806.35 (△ 0.51)	千ユーロ 1,853 (△ 1)	百株 24.04	千ユーロ 61
	ユーロ (ベルギー)	百株 74.22 ()	千ユーロ 534 ()	百株 6.99	千ユーロ 28
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 50.94 (△ 60)	千ユーロ 77 ()	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (フランス)	百株 1,126.57 ()	千ユーロ 4,507 (△ 6)	百株 38.91	千ユーロ 225
	ユーロ (ドイツ)	百株 981.48 ()	千ユーロ 4,512 (△ 23)	百株 30.78	千ユーロ 130
	ユーロ (ポルトガル)	百株 112.09 ()	千ユーロ 51 ()	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (スペイン)	百株 2,111.74 (△ 291.52)	千ユーロ 1,578 (△ 6)	百株 186.58	千ユーロ 78
	ユーロ (イタリア)	百株 2,744.28 (△ 131)	千ユーロ 1,093 (△ 35)	百株 92.65	千ユーロ 54
	ユーロ (フィンランド)	百株 336.44 ()	千ユーロ 491 ()	百株 6.17	千ユーロ 28
	ユーロ (オーストリア)	百株 32.09 ()	千ユーロ 111 (△ 2)	百株 —	千ユーロ —
国	ユーロ (その他)	百株 61.17 ()	千ユーロ 106 ()	百株 33	千ユーロ 82
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 8,561.13 (△ 1,972.86)	千ユーロ 15,127 (△ 75)	百株 419.12	千ユーロ 691

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

(2) 投資信託受益証券

(2017 年 1 月 11 日から 2018 年 1 月 10 日まで)

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

(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。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

(3) 投資信託証券

(2017年1月11日から2018年1月10日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	アメリカ	千口 50.39 (1.078)	千アメリカ・ドル 2,772 (2,772 51)	千口 2,778 (-)	千アメリカ・ドル 252 (-)
	カナダ	千口 3.4 (-)	千カナダ・ドル 80 (-)	千口 - (-)	千カナダ・ドル - (-)
	オーストラリア	千口 77.443 (25.756)	千オーストラリア・ドル 503 (240)	千口 4,552 (-)	千オーストラリア・ドル 45 (-)
	香港	千口 4 (34)	千香港ドル 210 (331)	千口 - (-)	千香港ドル - (-)
	シンガポール	千口 54 (-)	千シンガポール・ドル 106 (△ 0)	千口 - (-)	千シンガポール・ドル - (-)
	イギリス	千口 22.604 (△ 0.321)	千イギリス・ポンド 113 (△ 3)	千口 8,425 (-)	千イギリス・ポンド 16 (-)
国	ユーロ (フランス)	千口 1,992 (-)	千ユーロ 171 (△ 0)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)

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

■主要な売買銘柄
株 式

(2017年1月11日から2018年1月10日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2017年1月11日から2018年1月10日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	期首株数	期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC.	3.5	7.5	69	7,869	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC.	2.5	6	91	10,275	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1	5.5	78	8,846	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	27.5	51	201	22,618	金融
ABBOTT LABORATORIES	55.7	117.2	690	77,651	ヘルスケア
ARCONIC INC.	15	24	71	8,045	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC.	5	11.35	109	12,345	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP.	14	29	201	22,670	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP.-CL A	8	19.5	177	19,912	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC.	10.5	23.5	225	25,379	情報技術
QORVO INC.	2	7	48	5,431	情報技術
AFLAC INC.	13.5	30	270	30,361	金融
DARDEN RESTAURANTS INC.	5	8	77	8,770	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC.	—	10	43	4,916	一般消費財・サービス
ADOBE SYSTEMS INC.	16	33	616	69,281	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC.	11	17.5	74	8,357	素材
LULULEMON ATHLETICA INC.	2	5.5	43	4,917	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	5	19	36	4,074	金融
GARMIN LTD.	2	7.5	44	5,047	一般消費財・サービス
AETNA INC.	10.44	21.94	402	45,296	ヘルスケア
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC.	6.5	14	236	26,615	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC.	22.5	51	795	89,470	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC.	7	11.5	92	10,434	情報技術
VR BERKLEY CORP.	2	6	41	4,641	金融
AUTOZONE INC.	1	1.9	146	16,471	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC.	8.49	15.99	175	19,723	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	32	56	108	12,197	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	5	9	73	8,300	公益事業
CELANESE CORP.-SERIES A	6	9	97	10,978	素材
DR HORTON INC.	14.5	23.5	124	13,960	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4.5	4.5	24	2,806	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC.	7	15.5	101	11,407	ヘルスケア
AUTODESK INC.	7	12.5	140	15,758	情報技術
MOODY'S CORP.	5.5	12.5	195	21,944	金融
DEVON ENERGY CORP.	13	34	144	16,264	エネルギー
ALBEMARLE CORP.	3	8	108	12,184	素材
ATMOS ENERGY CORP.	3	6	49	5,572	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP.	6	13	53	5,980	公益事業
CITIGROUP INC.	91.8	189.8	1,429	160,734	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	14	30.5	362	40,731	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	16.5	32.5	229	25,794	公益事業
ALLEGHANY CORP.	0.3	0.8	46	5,224	金融
DUN & BRADSTREET CORP.	1	—	—	—	資本財・サービス
DOMINO'S PIZZA INC.	1.5	3	62	6,973	一般消費財・サービス
HESS CORP.	8.5	19.5	102	11,503	エネルギー
DAVITA INC.	6	10	77	8,711	ヘルスケア
DANAHER CORP.	19	41.3	407	45,796	ヘルスケア
FORTIVE CORP.	10	19	140	15,763	資本財・サービス
AVNET INC.	4	11	46	5,190	情報技術

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	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	18.25	41.25	305	34,348	金融
UNDER ARMOUR INC—CLASS A	2	12	18	2,038	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC—CLASS C	2.01	17.01	23	2,697	一般消費財・サービス
ARCHER—DANIELS—MIDLAND CO	19.5	37.5	150	16,960	生活必需品
BUNGE LTD	3	9.5	66	7,438	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	13	24	237	26,669	情報技術
APPLE INC	171.5	355.5	6,197	696,901	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14	27	211	23,754	金融
BOEING CO/THE	18.5	39.3	1,251	140,723	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6	9.5	69	7,820	金融
SPECTRA ENERGY CORP	23.5	—	—	—	その他
BECTON DICKINSON AND CO	6.73	19.11	432	48,655	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT—ADR	—	15	41	4,672	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	—	8.5	56	6,331	情報技術
CDK GLOBAL INC	6	11	79	8,910	情報技術
NISOURCE INC	9	20	49	5,555	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3	10.5	96	10,798	資本財・サービス
CR BARD INC	2	—	—	—	その他
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32	72.5	402	45,295	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	127.44	283.44	1,462	164,495	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC—CL B	37	86.2	1,750	196,791	金融
ANSYS INC	2	4.5	69	7,850	情報技術
H&R BLOCK INC	3	16	42	4,757	一般消費財・サービス
BB&T CORP	24.5	54	281	31,630	金融
BAKER HUGHES INC	13.81	—	—	—	その他
BRISTOL—MYERS SQUIBB CO	52.5	110	680	76,505	ヘルスケア
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	1	—	—	—	生活必需品
JPMORGAN CHASE & CO	113	240	2,617	294,304	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	7.5	15.5	173	19,477	金融
CIGNA CORP	8	16.5	342	38,568	ヘルスケア
LKQ CORP	12	20.5	86	9,679	一般消費財・サービス
COMPUTER SCIENCES CORP	5	—	—	—	その他
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	2	2	23	2,656	金融
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	19.21	—	—	—	電気通信サービス
BROWN—FORMAN CORP—CLASS B	9	14.5	97	10,997	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	8	17	76	8,615	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5.5	9.5	165	18,596	金融
DOLLAR GENERAL CORP	7.5	18.5	174	19,607	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	6	11.5	155	17,516	情報技術
CATERPILLAR INC	17.5	41	682	76,731	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	11	17	77	8,738	公益事業
MOSAIC CO/THE	7	30	78	8,808	素材
DELTA AIR LINES INC	4	10	54	6,091	資本財・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	7	—	—	—	その他
CORNING INC	31	59	198	22,325	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	157.5	348.5	1,383	155,540	情報技術
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	26	—	—	—	その他
MORGAN STANLEY	43.5	92.5	493	55,440	金融
WABCO HOLDINGS INC	1.2	3.2	47	5,391	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期 首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
DOW CHEMICAL CO/THE	33.5	—	—	—	その他
MSCI INC	1.5	7.3	97	11,008	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	—	2.2	46	5,236	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	2	4	53	6,039	資本財・サービス
COTY INC—CL A	11.17	24.17	49	5,596	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	—	10	42	4,753	情報技術
BROADCOM LTD	11.84	27.24	731	82,245	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	1	3	45	5,073	ヘルスケア
DICK'S SPORTING GOODS INC	2	—	—	—	一般消費財・サービス
ACUITY BRANDS INC	1	3.5	55	6,216	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	7	91	10,291	ヘルスケア
ARAMARK	10	17	74	8,329	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	5	14	46	5,181	素材
DTE ENERGY COMPANY	5	13.5	142	16,043	公益事業
CENTENE CORP	5	12	127	14,299	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	—	6	78	8,824	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15.5	30.5	134	15,155	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7.5	12	76	8,586	金融
GARTNER INC	2.5	5	64	7,250	情報技術
SPLUNK INC	6.5	11	98	11,066	情報技術
WHITEWAVE FOODS CO	7.5	—	—	—	その他
AGCO CORP	1	5	36	4,150	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC	18.5	44.5	343	38,636	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	10.5	27.5	180	20,248	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	3	8	50	5,689	資本財・サービス
DEERE & CO	8	18.5	306	34,450	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	5.5	12	125	14,143	情報技術
TIME WARNER INC	25.16	51.66	476	53,606	一般消費財・サービス
VMWARE INC—CLASS A	2	5	64	7,268	情報技術
CHEMOURS CO/THE	—	14	70	7,918	素材
TEGNA INC	11.5	—	—	—	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	5	8.5	68	7,662	金融
VAIL RESORTS INC	—	2.4	51	5,757	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	—	8.5	54	6,161	金融
TARGA RESOURCES CORP	6	11	53	6,001	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2.5	4.5	71	8,092	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	4.5	48	5,451	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	11	22.5	184	20,749	公益事業
COGNEX CORP	—	14	94	10,664	情報技術
MEDNAX INC	3	—	—	—	ヘルスケア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	5	7.5	85	9,561	一般消費財・サービス
TELEFLEX INC	2	3	78	8,843	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPORT SVCS INC	2	5	60	6,764	資本財・サービス
VEEVA SYSTEMS INC—CLASS A	—	6.5	37	4,241	ヘルスケア
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	3	7	46	5,190	資本財・サービス
IDEX CORP	—	4.5	61	6,869	資本財・サービス
COLGATE—PALMOLIVE CO	25.5	57.5	434	48,907	生活必需品
ROLLINS INC	—	7	33	3,749	資本財・サービス
AMETEK INC	9.75	14.75	109	12,273	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	9	14	70	7,932	生活必需品
KNIGHT—SWIFT TRANSPORTATION	—	10	44	5,049	資本財・サービス
LYONDELLBASELL INDU—CL A	11.5	24.5	282	31,724	素材

銘柄	期 首	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千アメリカ・ドル		邦貨換算金額 千円
COSTCO WHOLESALE CORP	13.5	30	558	62,844	生活必需品
SCANA CORP	3	7	31	3,526	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1	4	80	9,008	金融
WR GRACE & CO	1.5	5.5	40	4,508	素材
VALSPAR CORP/THE	2	—	—	—	その他
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0.8	1.4	44	5,027	一般消費財・サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP	14	28	77	8,690	金融
UGI CORP	5	10	47	5,373	公益事業
CUMMINS INC	5	11	200	22,507	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	19.5	48.5	321	36,098	情報技術
SABRE CORP	5	16	33	3,711	情報技術
CDW CORP/DE	3	13	94	10,651	情報技術
SIGNATURE BANK	1.5	3.5	49	5,589	金融
COSTAR GROUP INC	1.5	2.5	78	8,845	情報技術
SVB FINANCIAL GROUP	—	3	74	8,328	金融
AMERCO	—	0.7	26	2,951	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	—	4.4	61	6,900	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	1.5	2.8	94	10,631	情報技術
HANESBRANDS INC	17	29	63	7,086	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	4.5	54	6,123	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	5.83	15.33	125	14,123	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	—	10.5	40	4,571	情報技術
IPG PHOTONICS CORP	—	2.5	64	7,202	情報技術
DEXCOM INC	4	—	—	—	ヘルスケア
DIAMONDBACK ENERGY INC	3	6	76	8,601	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	4	10	55	6,233	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	3	5	125	14,137	ヘルスケア
TRANSIGM GROUP INC	2	3.5	98	11,114	資本財・サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	5	—	—	—	不動産
NIELSEN HOLDINGS PLC	11.5	25	90	10,213	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	58.96	146.96	278	31,299	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	11	22	189	21,275	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	18	29.5	85	9,659	エネルギー
T—MOBILE US INC	10.5	19.5	127	14,384	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC—C	—	7	29	3,319	情報技術
COCA—COLA CO/THE	128.5	283	1,308	147,119	生活必需品
COCA—COLA EUROPEAN PARTNERS	—	16	63	7,133	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	7.5	12.5	82	9,284	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	6	6	35	3,954	金融
FMC TECHNOLOGIES INC	11	—	—	—	その他
FRANKLIN RESOURCES INC	15	22	96	10,801	金融
CSX CORP	31	64.5	382	42,981	資本財・サービス
FLUOR CORP	3	7	37	4,235	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDS	3.5	7.5	127	14,382	ヘルスケア
EXPEDIA INC	4	8	101	11,450	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	3.5	5.5	72	8,206	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	12.7	28.2	3,532	397,242	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC—CLASS A	7	16	48	5,424	エネルギー
FLOWSERVE CORP	3	9	38	4,382	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7.5	13	155	17,470	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	131.76	294.26	2,553	287,117	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	1	8	39	4,443	情報技術

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	千アメリカ・ドル	千円	
AES CORP	17	40	43	4,839	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	2.5	6.5	133	14,983	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	1	3.5	75	8,538	金融
EOG RESOURCES INC	19	39.5	441	49,619	エネルギー
EQT CORP	6	19	111	12,541	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7	12.5	84	9,486	情報技術
AMERISOURCEBERGEN CORP	7	10	97	10,966	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9.5	25	179	20,176	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	108.5	247.5	323	36,403	一般消費財・サービス
TESARO INC	—	2	15	1,717	ヘルスケア
MACY'S INC	12	22	54	6,108	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	2	11	23	2,677	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5.16	12.16	42	4,792	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	3	12.5	25	2,881	一般消費財・サービス
MOBILEYE NV	5	—	—	—	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	8.5	8.5	45	5,111	資本財・サービス
FORTINET INC	3.5	10.5	46	5,232	情報技術
MARKEL CORP	0.5	1.1	123	13,886	金融
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	—	8	18	2,061	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	14	33.3	505	56,857	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	38.5	94.5	178	20,105	素材
US BANCORP	54	112	624	70,251	金融
UNITED RENTALS INC	2	6	103	11,633	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	3	5.5	75	8,525	情報技術
FASTENAL CO	9.5	20.5	113	12,761	資本財・サービス
FISERV INC	6.5	15	204	22,988	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	281.5	607.5	1,127	126,789	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	7.5	12.5	68	7,722	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	11.5	22.5	76	8,574	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	44	89	392	44,085	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	2	7	24	2,722	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	8.5	17.5	360	40,514	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	11.5	26.1	662	74,529	金融
ALPHABET INC-CL A	9.3	20.7	2,303	259,025	情報技術
ALPHABET INC-CL C	9.71	21.71	2,401	270,070	情報技術
OWENS CORNING	—	8	75	8,469	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	19	37.5	222	25,014	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	13.17	30.17	90	10,198	公益事業
GENUINE PARTS CO	5.5	12	118	13,352	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	13.55	26.05	121	13,709	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	23.5	45.5	142	15,988	金融
HARRIS CORP	5	7.5	109	12,281	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3	9.5	49	5,563	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	25	59.5	310	34,865	エネルギー
HOME DEPOT INC	39.5	82	1,583	178,055	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	2.5	2.5	24	2,786	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	36.5	76.5	116	13,101	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2	3.5	83	9,414	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	4.5	9.5	108	12,154	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	4	14	73	8,228	一般消費財・サービス
HUMANIA INC	4.5	9.5	249	28,104	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	10	20.5	242	27,305	情報技術

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	
HELMERICH & PAYNE	6	6	40	4,602	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	2.5	11	80	9,085	ヘルスケア
HP INC	58	107.5	234	26,364	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	50	102.5	152	17,116	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4	11	43	4,894	一般消費財・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	2	11	56	6,340	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	—	13.5	45	5,093	一般消費財・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-SIRIUSXM A	2	8.5	33	3,800	一般消費財・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5	8	69	7,847	金融
HARMAN INTERNATIONAL	1.5	—	—	—	その他
KRAFT HEINZ CO/THE	18.5	40	314	35,363	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	29	60	982	110,536	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	13.5	30.5	187	21,089	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4	9	63	7,116	資本財・サービス
ZOETIS INC	16.5	36.5	274	30,828	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	9.65	16.65	151	17,017	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	5	17.5	94	10,614	エネルギー
ALLEGION PLC	—	5.5	45	5,129	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	2	6.5	31	3,504	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18.86	35.86	119	13,480	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC-C	1.35	—	—	—	その他
WASTE CONNECTIONS INC	7	20	140	15,792	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	9	28.5	81	9,175	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	4	9	114	12,831	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	86	183.14	2,639	296,843	ヘルスケア
ABBVIE INC	51.66	111.66	1,119	125,863	ヘルスケア
HOLOGIC INC	11	18	79	8,950	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	10.5	23	268	30,208	生活必需品
KROGER CO	30	56	155	17,487	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	5	11	120	13,507	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	8.2	17.9	591	66,526	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3.3	7.3	143	16,164	情報技術
L BRANDS INC	8.5	19.5	92	10,389	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	27.5	58	548	61,666	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	31.5	71	611	68,709	ヘルスケア
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	10	—	—	—	その他
LAM RESEARCH CORP	6	10.5	207	23,327	情報技術
RANGE RESOURCES CORP	3	10	17	1,918	エネルギー
JONES LANG LASALLE INC	1	3	46	5,191	不動産
LOEWS CORP	12	18	92	10,349	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	9	13	106	11,940	金融
MCDONALD'S CORP	26	57	989	111,233	一般消費財・サービス
3M CO	19	42	1,013	113,954	資本財・サービス
FACEBOOK INC-A	72.5	164.5	3,090	347,522	情報技術
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	8.17	12.17	102	11,533	情報技術
MANPOWERGROUP INC	1	3.5	45	5,135	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	9	16.9	299	33,682	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2.3	3.5	79	8,973	素材
CONCHO RESOURCES INC	4	9.5	147	16,557	エネルギー
ENVISION HEALTHCARE CORP	5.33	5.33	18	2,092	ヘルスケア
FIRST DATA CORP-CLASS A	18.5	38.5	66	7,476	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	8	8	29	3,266	電気通信サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期 首	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千アメリカ・ドル		邦貨換算金額 千円
PHILLIPS 66	15.5	29.97	304	34,280	エネルギー
CONDUENT INC	7.51	—	—	—	情報技術
HILTON GRAND VACATIONS INC	1.75	—	—	—	一般消費財・サービス
MURPHY OIL CORP	3	—	—	—	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	—	29	93	10,559	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	18	28	94	10,588	一般消費財・サービス
MATTEL INC	14	14	22	2,490	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	—	20.38	207	23,290	情報技術
MCCORMICK & CO—NON VGTG SHRS	4.5	7	72	8,117	生活必需品
MYLAN NV	12.5	36.5	161	18,178	ヘルスケア
METLIFE INC	28	59	308	34,738	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	22	22	50	5,727	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	—	2.5	62	7,027	情報技術
ATHENE HOLDING LTD—CLASS A	—	5	25	2,839	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4.35	10.85	99	11,239	情報技術
MONSANTO CO	15	30.5	363	40,923	素材
METTLER—TOLEDO INTERNATIONAL	1	1.5	97	10,963	ヘルスケア
BAKER HUGHES A GE CO	—	23.31	81	9,182	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	4	9	182	20,519	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	—	5.36	33	3,719	金融
MERCK & CO. INC.	87.87	190.37	1,081	121,592	ヘルスケア
DOWDUPONT INC	—	163.3	1,230	138,347	素材
MASCO CORP	8	22	99	11,238	資本財・サービス
M & T BANK CORP	4.32	10.32	180	20,298	金融
MARSH & MCLENNAN COS	16.5	35	286	32,269	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL—CL A	10.95	21.95	302	33,990	一般消費財・サービス
WORKDAY INC—CLASS A	5	8	87	9,868	情報技術
SQUARE INC—A	—	19	77	8,734	情報技術
TRANSUNION	—	12	68	7,648	資本財・サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	4	11	70	7,894	一般消費財・サービス
VANTIV INC—CL A	4	13.6	104	11,789	情報技術
NETAPP INC	10	16	95	10,735	情報技術
NIKE INC—CL B	43.5	89	570	64,141	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	10	19	291	32,817	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5	16.5	152	17,164	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3	10.5	97	10,998	金融
ALLY FINANCIAL INC	19	33	100	11,273	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	5.5	12	372	41,884	資本財・サービス
APTIV PLC	9	21	194	21,902	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	15.5	31.5	120	13,499	素材
MCKESSON CORP	7	15	240	27,095	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	6	18	96	10,893	情報技術
XYLEM INC	7.5	13	90	10,159	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	49.5	109	1,143	128,564	生活必需品
NUCOR CORP	9	21.5	145	16,387	素材
WESTERN UNION CO	10	36	75	8,517	情報技術
NEWELL BRANDS INC	11.08	27.58	88	9,896	一般消費財・サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	23	50.5	378	42,527	エネルギー
LIBERTY BROADBAND—C	2	8	71	8,058	一般消費財・サービス
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	—	2	24	2,728	生活必需品
PAYCHEX INC	8.5	21.5	145	16,396	情報技術
PATTERSON COS INC	3	—	—	—	ヘルスケア

銘柄	期 首	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3.5	5.5	143	16,158	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	63	135	939	105,612	生活必需品
P G & E CORP	16.5	33	147	16,639	公益事業
PFIZER INC	192.08	413.58	1,505	169,332	ヘルスケア
ALKERMES PLC	6	10.5	59	6,687	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	19	31.5	146	16,502	公益事業
STRYKER CORP	11	23.5	377	42,487	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	4	9.7	201	22,613	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5.5	11.5	204	23,012	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	1	4	50	5,707	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	80.7	173.2	1,576	177,332	生活必需品
EXELON CORP	28.04	68.54	261	29,411	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	8	14	170	19,174	ヘルスケア
NVR INC	—	0.2	72	8,152	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	37.5	82.5	477	53,742	エネルギー
PEPSICO INC	45.85	99.85	1,179	132,581	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	13	29	345	38,806	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5.5	13.5	117	13,163	公益事業
ACCENTURE PLC—CL A	20	42	669	75,311	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	2	6	28	3,242	金融
PENTAIR PLC	5.75	10.25	74	8,400	資本財・サービス
QUALCOMM INC	46.5	99.5	649	73,029	情報技術
INVESCO LTD	16	25.5	94	10,667	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	3	5	55	6,212	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8.5	18	131	14,769	金融
RAYTHEON COMPANY	10	19.5	377	42,474	資本財・サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER—CL A	1	4.5	38	4,342	一般消費財・サービス
RED HAT INC	7	12.8	158	17,869	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	2.6	5	184	20,727	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	7	15	101	11,466	資本財・サービス
PRICELINE GROUP INC/THE	1.6	3.4	634	71,315	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	13.5	26	209	23,538	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	2.5	5.5	70	7,910	素材
RESMED INC	6	9.5	83	9,400	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	6	8.5	85	9,667	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	3	8	45	5,094	資本財・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	25.98	—	—	—	その他
RITE AID CORP	45	—	—	—	生活必需品
RALPH LAUREN CORP	1	4	41	4,722	一般消費財・サービス
AUTONATION INC	—	6.5	36	4,120	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	3	10.51	144	16,302	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	35.5	92.5	164	18,494	金融
CHEVRON CORP	59.5	129.5	1,655	186,164	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	9	23.5	149	16,785	公益事業
TESLA INC	4.5	9.3	310	34,896	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	20	39.5	114	12,885	情報技術
ENDO INTERNATIONAL PLC	3	—	—	—	ヘルスケア
STANLEY BLACK & DECKER INC	5.52	10.02	173	19,561	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	4	11	98	11,094	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC—A	6.53	13.23	469	52,778	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC — A	12	20	90	10,154	不動産
TWITTER INC	25	38	91	10,328	情報技術

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	千アメリカ・ドル	千円	
SOUTHERN CO/THE	29	69	321	36,164	公益事業
SYSCO CORP	15	37	227	25,538	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	9	19	251	28,302	金融
SOUTHWESTERN ENERGY CO	7	—	—	—	エネルギー
SEI INVESTMENTS COMPANY	4	10	75	8,467	金融
STERICYCLE INC	2	5	35	3,942	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	—	13	58	6,594	素材
SCHLUMBERGER LTD	44.93	93.93	703	79,112	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4	10.5	55	6,186	資本財・サービス
AT&T INC	194.7	419.7	1,573	176,935	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	5	9	56	6,313	資本財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2.8	5.4	229	25,759	素材
SEMPRA ENERGY	8.5	17	182	20,573	公益事業
TIFFANY & CO	4.5	7.5	79	8,985	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	11	17	78	8,868	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	33	66.5	734	82,548	情報技術
SALESFORCE.COM INC	21	46	502	56,460	情報技術
SIGNET JEWELERS LTD	1	—	—	—	一般消費財・サービス
WESTROCK CO	7.12	17.12	115	12,975	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	27.53	60.53	234	26,375	資本財・サービス
ANDEAVOR	4.5	10.5	121	13,701	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	26.5	56.5	796	89,583	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	24	61	110	12,381	エネルギー
MARATHON PETROLEUM INC	18.5	35.5	244	27,544	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	26	52.5	704	79,267	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	21.5	49	632	71,140	資本財・サービス
UNUM GROUP	6	12	68	7,686	金融
SPRINT CORP	41.14	41.14	23	2,632	電気通信サービス
ANTERO RESOURCES CORP	—	10	19	2,183	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	3.53	9.53	93	10,560	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	5	11	58	6,554	金融
AMEREN CORPORATION	8	18.5	106	11,924	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	30	66.1	1,493	167,895	ヘルスケア
VERISIGN INC	1.5	7.5	84	9,527	情報技術
VALERO ENERGY CORP	15	30	282	31,744	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	2.3	3.3	76	8,643	一般消費財・サービス
FNFG GROUP	11	17.5	71	8,034	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2	6	66	7,475	ヘルスケア
ANTHEM INC	8	18	422	47,497	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	48.5	105	1,154	129,808	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	149.87	321.87	2,003	225,345	金融
FOOT LOCKER INC	3	—	—	—	一般消費財・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	12.5	32	280	31,554	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	20	60	196	22,082	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5	10.5	83	9,385	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	2	5	84	9,466	一般消費財・サービス
WAL-MART STORES INC	48.5	102	1,023	115,146	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	—	9	83	9,376	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7.5	15.5	192	21,646	ヘルスケア
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	17	—	—	—	エネルギー
WYNN RESORTS LTD	2	5	81	9,187	一般消費財・サービス
XEROX CORP	37.59	9.39	28	3,187	情報技術

銘柄	期 首	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千アメリカ・ドル		邦貨換算金額 千円
WABTEC CORP	2	5	41	4,671	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	20.5	45.5	343	38,629	一般消費財・サービス
WATERS CORP	2.5	6.5	135	15,273	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	3.5	3.5	23	2,695	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	12.59	24.49	430	48,372	ヘルスケア
WHOLE FOODS MARKET INC	7	—	—	—	その他
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	28.5	61	447	50,362	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4.13	8.13	123	13,880	金融
WESTERN DIGITAL CORP	9.95	21.45	172	19,445	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	8.5	22	142	16,058	公益事業
WESTAR ENERGY INC	4	9	47	5,287	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	15	35	173	19,533	公益事業
VISA INC—CLASS A SHARES	59	127.5	1,518	170,772	情報技術
PPL CORP	18	46	144	16,206	公益事業
PULTEGROUP INC	7	19	65	7,403	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	9	17.1	202	22,732	素材
NORTHERN TRUST CORP	6.5	16	166	18,758	金融
NVIDIA CORP	16	42.5	943	106,067	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	—	6	80	9,009	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15.03	33.03	488	54,903	金融
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q—A	18	29	76	8,547	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	12	46	5,270	資本財・サービス
TYSON FOODS INC—CL A	7.5	19.5	160	18,037	生活必需品
NETFLIX INC	13	30	627	70,610	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	12	27.5	566	63,733	ヘルスケア
TORCHMARK CORP	3.5	6.5	59	6,729	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5	9	79	8,926	金融
TEXTRON INC	10	16	93	10,516	資本財・サービス
TWENTY—FIRST CENTURY FOX—A	37.5	78.5	286	32,255	一般消費財・サービス
TWENTY—FIRST CENTURY FOX — B	9	32	115	13,019	一般消費財・サービス
NEWS CORP — CLASS A	8	29	48	5,504	一般消費財・サービス
OGE ENERGY CORP	5	12	38	4,331	公益事業
OMNICOM GROUP	7.5	18.5	133	14,994	一般消費財・サービス
ORACLE CORP	99	217	1,064	119,714	情報技術
MASTERCARD INC — A	30	63.5	1,012	113,892	情報技術
ONEOK INC	5	22.5	127	14,292	エネルギー
CENTURYLINK INC	16.97	54.39	89	10,116	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	3.5	7.5	202	22,798	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	9.5	21	173	19,543	一般消費財・サービス
TAKE—TWO INTERACTIVE SOFTWARE	—	8	91	10,337	情報技術
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2.5	4	107	12,052	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO—B	6.5	12.5	104	11,755	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	10.5	37.5	117	13,186	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	322.63	682.63	2,066	232,357	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5	11	98	11,026	ヘルスケア
NORDSTROM INC	2	8	38	4,308	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	25	52.5	527	59,343	金融
ANALOG DEVICES INC	8	23.44	214	24,154	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	—	58	68	7,709	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	10	17.08	91	10,308	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32.2	61.7	374	42,066	金融
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	1	—	—	—	素材

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期 首	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 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	
ANADARKO PETROLEUM CORP	18	43	238	26,845	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7	12	120	13,585	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5.5	11	135	15,233	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	5	12	41	4,658	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	2	—	—	—	ヘルスケア
AVERY DENNISON CORP	3	6.5	77	8,691	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS—A	19.5	38	279	31,390	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	21	44.5	321	36,189	資本財・サービス
AON PLC	8.5	17	232	26,174	金融
AMGEN INC	24	49	898	101,043	ヘルスケア
CORE LABORATORIES N.V.	1	—	—	—	エネルギー
TAPESTRY INC	12	18	81	9,179	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	15.12	30.62	251	28,227	資本財・サービス
CELGENE CORP	24.5	52.5	553	62,277	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC—A	6	11.5	255	28,718	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	33.5	77.1	422	47,563	情報技術
CIT GROUP INC	9	9	46	5,200	金融
CIMAREX ENERGY CO	2.5	8	102	11,479	エネルギー
CME GROUP INC	10	23	351	39,475	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	14.89	21.89	83	9,412	エネルギー
ECOLAB INC	8.5	17	232	26,124	素材
EQUIFAX INC	4.5	8.5	103	11,684	資本財・サービス
GAP INC/THE	3	13	41	4,676	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	41.5	90	702	79,041	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	4.76	10.76	102	11,557	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	6	22	80	9,004	生活必需品
STATE STREET CORP	13	26.5	268	30,216	金融
STAPLES INC	8	—	—	—	その他
SUNTRUST BANKS INC	13.5	34	227	25,596	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	35.5	81	432	48,584	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	13	33.5	232	26,135	ヘルスケア
B/E AEROSPACE INC	2.5	—	—	—	その他
CAMPBELL SOUP CO	8	13	61	6,914	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	3	8	45	5,089	素材
CARDINAL HEALTH INC	9.5	24.5	164	18,486	ヘルスケア
FEDEX CORP	8.5	18	481	54,195	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15	33	335	37,735	金融
FMC CORP	3	7.5	73	8,276	素材
FLEX LTD	10	45	84	9,457	情報技術
CERNER CORP	9.5	18.5	132	14,915	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2	6.5	100	11,275	素材
CITRIX SYSTEMS INC	5.5	9.5	86	9,741	情報技術
INTEL CORP	148.5	322.5	1,406	158,188	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	17	28	56	6,394	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	10.5	28.5	156	17,616	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	10	22.5	379	42,723	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30	80	42	4,776	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC	5.5	11.1	269	30,306	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	8.5	14.5	71	7,984	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	1.3	7.5	298	33,532	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6	8.5	87	9,864	情報技術
SNAP—ON INC	1.5	3	53	6,030	資本財・サービス

銘柄	期 首	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CALPINE CORP	12	—	—	—	公益事業
CARMAX INC	8	12	83	9,418	一般消費財・サービス
COMERICA INC	7	11	99	11,178	金融
INGREDION INC	3	5.3	73	8,316	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	22.38	48.38	393	44,197	公益事業
TARGET CORP	17.5	37	255	28,766	一般消費財・サービス
DOVER CORP	5.5	12	124	14,040	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	2.5	4	94	10,673	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2	6	40	4,568	資本財・サービス
CINTAS CORP	3.5	5.5	88	9,971	資本財・サービス
CA INC	6	22	74	8,351	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	11	25	93	10,511	生活必需品
CLOROX COMPANY	4.5	9	131	14,792	生活必需品
ENTERGY CORP	4.5	11	88	9,910	公益事業
MICROSOFT CORP	232	506.5	4,468	502,465	情報技術
INCYTE CORP	6	10.5	101	11,369	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	33	69.5	539	60,716	生活必需品
MEDTRONIC PLC	42.56	92.56	794	89,387	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	36	77.5	333	37,447	情報技術
BLACKROCK INC	3.8	8.1	432	48,633	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	9	29	80	9,052	公益事業
HASBRO INC	3	6	56	6,338	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	7	18.5	127	14,308	生活必需品
KEYCORP	40	71	147	16,558	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	2	7.5	82	9,316	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC—A	52	103	442	49,792	生活必需品
KOHL'S CORP	7.5	8.5	48	5,450	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	1	3.5	81	9,219	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	23	23	30	3,395	金融
APACHE CORP	14	25	111	12,524	エネルギー
CHUBB LTD	14.1	33.6	490	55,106	金融
ARROW ELECTRONICS INC	4.5	4.5	37	4,250	情報技術
ALLSTATE CORP	12.5	25	252	28,376	金融
EBAY INC	34	66.5	262	29,560	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC	34	81.5	645	72,575	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	6	9	87	9,844	素材
XILINX INC	8	16.5	123	13,886	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	21.35	37.85	302	34,011	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP—A	6.5	15	72	8,192	一般消費財・サービス
YAHOO! INC	28.5	—	—	—	その他
ZIONS BANCORPORATION	—	12	62	6,991	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES—CL A	5.5	14.5	190	21,474	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	4	12	62	7,030	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	5	22	94	10,603	情報技術
LINEAR TECHNOLOGY CORP	9	—	—	—	その他
LENNAR CORP—A	8.5	14	93	10,495	一般消費財・サービス
LEAR CORP	2	4	75	8,518	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	7	23	120	13,570	金融
PROGRESSIVE CORP	15.5	43.5	244	27,475	金融
PRAXAIR INC	8	20.5	333	37,547	素材
PACCAR INC	11	23	172	19,353	資本財・サービス
PVH CORP	3.5	5.5	77	8,730	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首 株数	当期末			業種等
		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	
BIOGEN INC	6.5	14.5	487	54,844	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	2	5.5	91	10,249	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	46.5	103.5	612	68,877	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC	5	9	81	9,193	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	10	24	148	16,673	公益事業
INTUIT INC	8	16	263	29,659	情報技術
BORGWARNER INC	9	15.5	86	9,715	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	11	17	118	13,339	一般消費財・サービス
BALL CORP	5.46	18.92	72	8,191	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	45.5	102.5	286	32,227	ヘルスケア
BED BATH & BEYOND INC	3	—	—	—	一般消費財・サービス
XL GROUP LTD	12	18.5	63	7,116	金融
ELECTRONIC ARTS INC	10.5	22.5	252	28,382	情報技術
VULCAN MATERIALS CO	3.5	10.5	140	15,838	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6.5	17.7	276	31,051	ヘルスケア
VF CORP	11	21	159	17,977	一般消費財・サービス
CBS CORP—CLASS B NON VOTING	14	22	123	13,851	一般消費財・サービス
VIACOM INC—CLASS B	14	20	58	6,531	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	2.5	4.8	134	15,101	一般消費財・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	5	—	—	—	情報技術
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3	6	67	7,619	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	10	24.5	165	18,632	一般消費財・サービス
COMCAST CORP—CLASS A	75	318	1,291	145,217	一般消費財・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	—	11	43	4,913	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	10	15	93	10,503	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20	110	78	8,856	不動産
アメリカ・ドル 通貨計	株数・金額 銘柄数<北米>	9,721.77 594銘柄	20,843.96 600銘柄	164,975 <61.0%>	18,551,533
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	14	23	91	8,212	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	0.5	1.5	109	9,895	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9.38	9.38	29	2,678	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	8.21	14.21	110	9,987	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	9	22	57	5,207	素材
INTACT FINANCIAL CORP	3	10	103	9,315	金融
BCE INC	3	9	52	4,753	電気通信サービス
FRANCO—NEVADA CORP	7	11	107	9,714	素材
SUNCOR ENERGY INC	61.12	118.12	555	50,059	エネルギー
METRO INC	6	16	66	6,010	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	10	23	146	13,206	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	43	82	679	61,273	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14	29	357	32,276	金融
TORONTO—DOMINION BANK	63	126	931	83,994	金融
GREAT—WEST LIFECO INC	7	17	59	5,331	金融
ROYAL BANK OF CANADA	51	98	1,027	92,643	金融
TOURMALINE OIL CORP	13	13	27	2,452	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	4	4	19	1,713	エネルギー
TRANSCANADA CORP	27	57	347	31,377	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	18	37.71	169	15,263	エネルギー
BOMBARDIER INC—B	47	192	56	5,107	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	47	83	150	13,576	素材
CAE INC	7	23	54	4,873	資本財・サービス

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	
THOMSON REUTERS CORP	14.2	20.2	110	9,997	金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	26	—	—	—	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	—	18	44	4,018	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	6	49	4,449	素材
CCL INDUSTRIES INC – CL B	1	10	57	5,139	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	19	19	17	1,615	金融
LINAMAR CORP	—	6	44	4,045	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY – A	11	11	19	1,745	エネルギー
HYDRO ONE LTD	15	15	33	2,994	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	9.89	14.89	101	9,111	生活必需品
CANADIAN UTILITIES LTD – A	10	10	36	3,282	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC – B	15	22	138	12,505	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	6	18	104	9,455	素材
KINROSS GOLD CORP	25.34	105.34	54	4,910	素材
BANK OF MONTREAL	22	46	471	42,477	金融
POWER CORP OF CANADA	16	31	99	9,000	金融
METHANEX CORP	6	6	45	4,139	素材
SHOPIFY INC – CLASS A	—	5	68	6,219	情報技術
NUTRIEN LTD	—	43.27	284	25,633	素材
CAMECO CORP	4	28	32	2,941	エネルギー
TELUS CORP	3	3	13	1,259	電気通信サービス
POWER FINANCIAL CORP	10	20	68	6,183	金融
TECK RESOURCES LTD – CLS B	17	44	156	14,088	素材
CANADIAN TIRE CORP – CLASS A	3	5	83	7,551	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	80	80	33	3,051	素材
AGRIUM INC	6	—	—	—	その他
CANADIAN NATURAL RESOURCES	41	78	359	32,388	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HDGS LTD	0.5	2	128	11,582	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	12	24	177	15,975	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	2	2	21	1,959	生活必需品
BLACKBERRY LTD	27	27	48	4,367	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	19	42	216	19,522	金融
ENBRIDGE INC	30	115	576	52,024	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE – CL A	31	55	298	26,924	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	63	138	367	33,174	金融
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	—	20	59	5,368	ヘルスケア
GOLDCORP INC	26	63	106	9,577	素材
ENCANA CORP	44	69	117	10,583	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4	10	232	20,995	資本財・サービス
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	4	11	66	5,974	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	4	14	56	5,106	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	25	53	554	50,041	資本財・サービス
CGI GROUP INC – CLASS A	7	13	87	7,857	情報技術
HUSKY ENERGY INC	6.12	30.12	55	5,000	エネルギー
ONEX CORPORATION	3	7	63	5,680	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC – B	22	39	110	9,973	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	7	7	22	2,057	資本財・サービス
SNC – LAVALIN GROUP INC	3	9	51	4,625	資本財・サービス
ELDORADO GOLD CORP	3	—	—	—	素材
IGM FINANCIAL INC	3	3	13	1,185	金融
OPEN TEXT CORP	3	14	58	5,318	情報技術
CI FINANCIAL CORP	6	20	58	5,298	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期 首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
SAPUTO INC	6	13	56	5,123	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33	63	117	10,588	素材
ALIMENTATION COUCHE -TARD -B	13	30	199	17,975	生活必需品
YAMANA GOLD INC	52	-	-	-	素材
FORTIS INC	13	30	134	12,118	公益事業
LUNDIN MINING CORP	-	66	55	5,022	素材
CRESCENT POINT ENERGY CORP	25	25	26	2,360	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC	25	80	103	9,327	エネルギー
DOLLARAMA INC	2	9	139	12,538	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	-	8	35	3,173	公益事業
ALTAGAS LTD	8	8	23	2,080	エネルギー
FIRST CAPITAL REALTY INC	-	20	42	3,814	不動産
KEYERA CORP	7	7	25	2,283	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	7	-	-	-	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	8	20	52	4,701	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	10	28	39	3,597	エネルギー
カナダ・ドル株数、金額 通 貨 計 通貨計	1,396.26 82銘柄	2,877.74 86銘柄	12,443 1,122,012	< 3.7%>	
(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	-	160	32	2,882	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD	93	228.24	73	6,458	金融
BHP BILLITON LIMITED	116	219.58	682	59,935	素材
SOUTH32 LTD	225	362.13	135	11,870	素材
LENDELEASE GROUP	20	-	-	-	不動産
ALUMINA LTD	121	121	30	2,690	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	20	57.74	200	17,582	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	48	105	55	4,899	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	8	36	42	3,758	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	87	172.43	510	44,883	金融
WESTPAC BANKING CORP	108.5	230.26	726	63,842	金融
SANTOS LTD	96	96	53	4,715	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	97	190.88	552	48,545	金融
RIO TINTO LTD	12	31.47	251	22,088	素材
ORIGIN ENERGY LTD	68	120.5	117	10,335	エネルギー
AMCOR LIMITED	51	74.96	113	9,980	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	85	153.1	74	6,511	資本財・サービス
OIL SEARCH LTD	32	84	67	5,949	エネルギー
SEEK LTD	26	26	50	4,398	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	26	55.92	86	7,558	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	22	58.04	134	11,828	素材
INCITEC PIVOT LTD	73	73	29	2,553	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	58	116.77	959	84,341	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	8	20	69	6,063	エネルギー
ORICA LTD	20	20	37	3,300	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	60	88	92	8,151	金融
CIMIC GROUP LTD	-	10	51	4,517	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	49	95.16	259	22,804	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	26	26	21	1,930	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	24	88	46	4,121	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	-	30	38	3,411	一般消費財・サービス
TELSTRA CORP LTD	136	351.14	131	11,571	電気通信サービス
AMP LTD	93.13	165.13	86	7,575	金融

銘柄	株数	期首	当		期末		業種等
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
JAMES HARDIE INDUSTRIES - CDI	12	32	71	6,290			素材
MACQUARIE GROUP LTD	12.31	21.13	215	18,944			金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	20	40.35	91	8,035			一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	30	30	38	3,364			金融
CSL LTD	15.5	31.02	440	38,682			ヘルスケア
WESFARMERS LTD	35.75	69.85	310	27,291			生活必需品
COCHLEAR LTD	2	4.44	77	6,769			ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	-	32.12	51	4,547			素材
SUNCORP GROUP LTD	39	99.38	137	12,052			金融
BORAL LTD	24	86	66	5,872			素材
ASX LTD	6	13	72	6,389			金融
COMPUTERSHARE LTD	9	37	60	5,309			情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	57	175.18	126	11,084			金融
SONIC HEALTHCARE LTD	8	25	58	5,162			ヘルスケア
TRANSURBAN GROUP	80.22	-	-	-			資本財・サービス
CHALLENGER LTD	25	25	35	3,082			金融
SYDNEY AIRPORT	38	-	-	-			資本財・サービス
TATTS GROUP LTD	80	-	-	-			一般消費財・サービス
AGL ENERGY LTD	25	40.5	99	8,744			公益事業
BRAMBLES LTD	45	113.37	113	9,992			資本財・サービス
APA GROUP	31	-	-	-			公益事業
DUET GROUP	100	-	-	-			その他
RAMSAY HEALTH CARE LTD	4	9	63	5,575			ヘルスケア
REA GROUP LTD	-	6.08	46	4,120			情報技術
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	-	6.21	28	2,538			一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,607.41 52銘柄	4,563.08 52銘柄	8,021 704,909	- - - - < 2.3%>		
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	60	90	603	8,671			公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	60	170	1,037	14,924			一般消費財・サービス
MTR CORP	75	75	347	4,998			資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	50	90	1,209	17,394			不動産
SINO LAND CO	120	340	498	7,167			不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	100.52	195.52	1,940	27,904			資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	40	80	260	3,750			不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	10	35	273	3,925			不動産
CLP HOLDINGS LTD	70	100	792	11,388			公益事業
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	40	-	-	-			資本財・サービス
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	36.9	95.59	511	7,354			不動産
HANG LUNG GROUP LTD	-	80	247	3,560			不動産
HONG KONG & CHINA GAS	324.51	510.96	794	11,418			公益事業
HANG SENG BANK LTD	34	47	901	12,962			金融
WHEELLOCK & CO LTD	20	60	360	5,176			不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	90	320	400	5,752			不動産
WH GROUP LTD	225	585	518	7,461			生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	38	80	2,152	30,945			金融
MINH GROUP LTD	-	60	289	4,167			一般消費財・サービス
LI & FUNG LTD	60	700	301	4,328			一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	120	120	243	3,502			不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	-	20	223	3,209			情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HDG	10	80	242	3,491			一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	-	150	218	3,136			資本財・サービス

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	期末			業種等
		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	
KERRY PROPERTIES LTD	—	75	273	3,936	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	20	86	291	4,198	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	—	60	265	3,813	不動産
SJM HOLDINGS LTD	100	100	73	1,058	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	80	80	212	3,054	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	105.52	185.52	1,329	19,114	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	20	55	370	5,326	公益事業
PCCW LTD	—	600	286	4,124	電気通信サービス
AIA GROUP LTD	380	876	5,807	83,517	金融
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	—	320	262	3,773	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	—	140	742	10,669	不動産
SANDS CHINA LTD	102	166	694	9,989	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	40	40	71	1,027	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	55	120	617	8,878	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	—	140	324	4,670	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	155	290	1,154	16,597	金融
WYNN MACAU LTD	60	60	145	2,092	一般消費財・サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	130	—	—	—	電気通信サービス
香港ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,831.45 32銘柄	7,477.59 40銘柄	27,290 < 1.3%>	392,436
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	53	90	250	21,056	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	68	128	339	28,557	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	20	20	21	1,844	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	28	93	73	6,144	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	—	52	48	4,061	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	10	10	12	1,077	不動産
CAPITALAND LTD	70	190	71	6,044	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING	—	270	42	3,590	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	120	120	32	2,746	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	—	9	36	3,102	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	105	218	281	23,685	金融
GENTING SINGAPORE PLC	450	450	60	5,074	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	277	484	175	14,786	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	40	141	47	3,963	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	40	40	12	1,063	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	90	90	3	291	生活必需品
SATS LTD	—	77	42	3,538	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	20	69	52	4,424	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	100	100	20	1,683	資本財・サービス
STARHUB LTD	120	120	34	2,918	電気通信サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	50	158	50	4,268	生活必需品
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	40	190	64	5,388	不動産
シンガポール・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,701 18銘柄	3,119 22銘柄	1,774 < 0.5%>	149,314
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージー ランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	150	150	44	3,593	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	56	168.6	60	4,879	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	31	81	53	4,294	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	19	19	14	1,180	素材

銘柄	期首 株数	当期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
RYMAN HEALTHCARE LTD	—	44.19	49	4,003	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル 通貨計	株数・金額 銘柄数<比率>	256 4銘柄	462.79 5銘柄	223 17,951 < 0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT	50	50	17	2,712	一般消費財・サービス
TUI AG—DI	26	26	40	6,181	一般消費財・サービス
BP PLC	569	1,328.11	701	106,700	エネルギー
UNILEVER PLC	44.2	87.04	355	54,088	生活必需品
BARCLAYS PLC	537.5	1,202.18	242	36,914	金融
ROLLS—ROYCE HOLDINGS PLC	45.5	107.7	93	14,204	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	32	105	33	5,085	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	2	5	35	5,474	素材
PRUDENTIAL PLC	77.5	172.78	329	50,161	金融
INMARSAT PLC	12	—	—	—	電気通信サービス
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	151.7	236.79	66	10,106	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	3.3	10.3	33	5,046	素材
BAE SYSTEMS PLC	85	243	139	21,171	資本財・サービス
AVIVA PLC	140.54	273.06	140	21,447	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	156.5	349.92	471	71,708	ヘルスケア
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	—	31.33	68	10,492	情報技術
WORLDPAY GROUP PLC	57	135.17	60	9,195	情報技術
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	29	18	2,806	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	42	42	14	2,252	情報技術
DCC PLC	1.5	5	38	5,831	資本財・サービス
CONVATEC GROUP PLC	—	65.81	13	1,982	ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC	32.5	100.76	46	7,090	資本財・サービス
RELX PLC	37	66	111	17,012	資本財・サービス
DIAGEO PLC	79.5	172.54	458	69,834	生活必需品
RIO TINTO PLC	37.5	80.59	329	50,202	素材
STANDARD CHARTERED PLC	104	220.5	174	26,599	金融
TESCO PLC	237.5	591.54	126	19,297	生活必需品
FRESNILLO PLC	8	24	33	5,134	素材
SMITH & NEPHEW PLC	24	59.67	76	11,607	ヘルスケア
GLENCORE PLC	376.5	805.44	320	48,801	素材
WOOD GROUP (JOHN) PLC	—	54.66	37	5,707	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15	15	27	4,144	金融
SMITHS GROUP PLC	9	22.6	34	5,304	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	6	6	4	650	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	47	109.63	40	6,222	金融
DIXONS CARPHONE PLC	47	—	—	—	一般消費財・サービス
PEARSON PLC	15	43	31	4,829	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	68.5	68.5	17	2,589	生活必需品
NEXT PLC	6	11.59	58	8,852	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	40	170	35	5,403	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	4	9.5	37	5,699	一般消費財・サービス
IMI PLC	4.75	24.1	33	5,122	資本財・サービス
BUNZL PLC	9	19	38	5,848	資本財・サービス
GKN PLC	26	92	30	4,611	一般消費財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	778.45	1,831.14	435	66,313	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	1.93	8.03	36	5,512	素材
KINGFISHER PLC	97	172.29	58	8,936	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価額	外貨建金額	
	株	株	千円	千円	
WPP PLC	40.5	99.21	132	20,228	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	14.4	36.9	28	4,391	公益事業
SEVERN TRENT PLC	13	13	26	4,080	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	18.3	48.18	329	50,203	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	27	27	33	5,157	金融
SCHROEDERS PLC	5.5	5.5	19	3,037	金融
TATE & LYLE PLC	20	—	—	—	生活必需品
SSE PLC	32	61.06	79	12,171	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	13	13	29	4,529	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	13	59	37	5,776	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	39	86.08	444	67,637	ヘルスケア
FERGUSON PLC	6.73	16	87	13,375	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	230.5	399.29	108	16,470	金融
3I GROUP PLC	28	57.37	52	8,020	金融
SKY PLC	41	63	64	9,758	一般消費財・サービス
ASHTON GROUP PLC	12	39	79	12,153	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	23.79	58.79	47	7,202	情報技術
NATIONAL GRID PLC	107.5	228.11	194	29,527	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,157.78	5,124.1	350	53,330	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	23.8	63.8	39	6,038	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	29.5	61.07	193	29,484	生活必需品
CENTRICA PLC	168	380.02	53	8,176	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7	7	29	4,516	一般消費財・サービス
PROVIDENT FINANCIAL PLC	5.5	—	—	—	金融
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	57.55	160.83	797	121,368	生活必需品
BHP BILLITON PLC	65	135.12	217	33,031	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10.5	29.6	84	12,800	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	620.5	1,400.19	1,072	163,262	金融
SHIRE PLC	26.22	64.38	238	36,328	ヘルスケア
OLD MUTUAL PLC	197.12	307.12	69	10,617	金融
ANGLO AMERICAN PLC	54	91.68	153	23,394	素材
MONDI PLC	19	34	65	9,976	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	57	145	33	5,125	生活必需品
CARNIVAL PLC	4	13.83	68	10,353	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	—	16.44	24	3,771	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	53.08	105.61	163	24,932	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	16	25.69	69	10,612	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	276	557.73	152	23,218	電気通信サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	—	12	28	4,345	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	21	33	58	8,922	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	2.94	13.72	64	9,799	一般消費財・サービス
CAPITA PLC	11	49	20	3,047	資本財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC	3	17	26	4,052	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	3	10	52	8,024	資本財・サービス
ITV PLC	151.5	275.87	46	7,125	一般消費財・サービス
PETROFAC LTD	9	—	—	—	エネルギー
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	13.5	20.35	75	11,515	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	133	313.55	794	120,944	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	120.27	254.47	653	99,472	エネルギー
MEGGITT PLC	35	35	17	2,621	資本財・サービス
G4S PLC	32	113.2	32	4,917	資本財・サービス
COBHAM PLC	34	196.77	23	3,649	資本財・サービス

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価額	外貨建金額	
	株	株	千円	千円	
ADMIRAL GROUP PLC	4	15.7	29	4,564	金融
INVESTEC PLC	9	46	24	3,733	金融
ANTOFAGASTA PLC	7	34.6	34	5,264	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	92.09	204.57	88	13,540	金融
EXPERIAN PLC	28	56.18	93	14,275	資本財・サービス
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	9,386.44 98銘柄	21,017.95 99銘柄	13,398 < 6.7%>	
(イスラエル)	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	
AZRIELI GROUP LTD	—	5.3	99	3,249	不動産
FRUTAROM	—	4.18	131	4,279	素材
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	50	50	26	865	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	3	3	138	4,535	資本財・サービス
BANK HAPOLIM BM	34	79	200	6,548	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	48	114	242	7,915	金融
NICE LTD	2	2	64	2,118	情報技術
イスラエル・シェケル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	137 5銘柄	257.48 7銘柄	903 < 0.1%>	
(スイス)	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	
DUFREY AG-REG	1.5	1.89	27	3,188	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	125.5	251.61	467	53,434	金融
BMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.5	0.5	34	3,963	素材
ADECCO GROUP AG-REG	3.5	10.87	85	9,812	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	24.1	50.2	1,253	143,331	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	—	3.89	34	3,939	金融
SIKA AG-BR	0.1	0.14	116	13,289	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	—	0.01	71	8,115	生活必需品
ABB LTD-REG	68	131.26	355	40,613	資本財・サービス
ARYZTA AG	2	—	—	—	生活必需品
SWISS RE AG	11.5	20.5	188	21,547	金融
NESTLE SA-REG	106	217	1,831	209,338	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	0.5	1.63	112	12,883	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1.5	3	70	8,058	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	72.31	185.03	329	37,687	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	5	15.65	97	11,169	金融
SGS SA-REG	0.17	0.32	83	9,546	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	0.12	3.69	50	5,807	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1	1.8	74	8,464	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.3	10.63	328	37,507	金融
BALOISE HOLDING AG-REG	1	3.2	49	5,705	金融
CLARIANT AG-REG	—	15.68	43	5,009	素材
NOVARTIS AG-REG	75.3	153.52	1,304	149,082	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	—	0.2	41	4,686	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	16.5	39.17	351	40,231	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	1.2	1.8	95	10,916	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG	1	2.34	101	11,610	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	0.35	0.68	154	17,658	素材
ACTELION LTD-REG	4	—	—	—	その他
STRAUMANN HOLDING AG-REG	—	0.52	37	4,264	ヘルスケア
SYNGENTA AG-REG	3.4	—	—	—	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	1	3	47	5,378	ヘルスケア
LONZA GROUP AG-REG	2.5	5.42	146	16,788	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額	
			外貨建金額	
		百株	千円	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	—	4.5	3,996	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	16.7	31.17	21,034	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1.5	2.31	9,280	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1	3	6,213	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	4.5	4.5	4,680	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.03	0.1	6,869	生活必需品
スイス・フラン 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	558.58 33銘柄	1,180.73 36銘柄	8,443 < 3.2%>
(デンマーク)		百株	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	67.5	129.05	4,411	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	24	59.44	1,446	金融
ISS A/S	6	13.2	322	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.1	0.3	327	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	—	5	160	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	6	13.38	581	資本財・サービス
TDC A/S	13	68	266	電気通信サービス
CARLSBERG AS-B	5.5	8.06	622	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	5	18.02	639	11,527 素材
COLOPLAST-B	6.5	6.5	331	5,966 ヘルスケア
DSV A/S	6	12	609	10,980 資本財・サービス
WILLIAM DEMANT HOLDING	—	13.14	233	4,212 ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.26	0.43	491	8,856 資本財・サービス
TRYG A/S	—	17	265	4,788 金融
PANDORA A/S	3	7.5	510	9,201 一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	3.5	7.5	444	8,014 素材
GENMAB A/S	1.5	4.33	499	8,992 ヘルスケア
ORSTED A/S	8	15.33	522	9,420 公益事業
デンマーク・クローネ 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	155.86 15銘柄	398.18 18銘柄	12,687 < 0.8%>
(ノルウェー)		百株	千円	
NORSK HYDRO ASA	27	74.5	460	6,387 素材
DNB ASA	30	62.45	985	13,658 金融
ORKLA ASA	42	70	596	8,266 生活必需品
TELENOR ASA	29	46	854	11,839 電気通信サービス
STATOIL ASA	43.5	76.17	1,404	19,467 エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	8.5	14.5	567	7,865 素材
MARINE HARVEST	8.5	23.5	325	4,509 生活必需品
GIJENSIDIGE FORSKRING ASA	—	20	318	4,413 金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	5	17	388	5,383 一般消費財・サービス
ノルウェー・クローネ 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	193.5 8銘柄	404.12 9銘柄	5,901 < 0.3%>
(スウェーデン)		百株	千円	
ICA GRUPPEN AB	—	7	209	2,859 生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	81	207	1,159	15,828 情報技術
VOLVO AB-B SHS	63	101.88	1,618	22,097 資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2	7.77	445	6,087 電気通信サービス
SKF AB-B SHARES	7	21	397	5,426 資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	15	15	402	5,489 一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB	102	230.18	2,339	31,937 金融
SWEDISH MATCH AB	3	12	387	5,295 生活必需品

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・ クローネ	千円	
TELE2 AB-B SHS	3	32.58	342	4,671	電気通信サービス
GETINGE AB-B SHS	2	19	224	3,065	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	49	96	973	13,294	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60	100	1,174	16,031	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	34	71.08	1,457	19,889	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	35	66.23	1,057	14,439	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	18	-	-	-	素材
SKANSKA AB-B SHS	18	18	312	4,264	資本財・サービス
SANDVIK AB	45	81.22	1,242	16,956	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	12	33.82	1,333	18,197	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	24	50.28	1,892	25,826	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	5	25	369	5,045	資本財・サービス
TELIA CO AB	84	158	607	8,298	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB	4	20	407	5,555	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	16	25	834	11,387	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	41	67.9	1,200	16,381	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	-	4.74	304	4,160	金融
LUNDIN PETROLEUM AB	8	19	385	5,259	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	-	50.5	1,188	16,226	生活必需品
BOLIDEN AB	8	18	539	7,366	素材
HUSQVARNA AB-B SHS	24	24	196	2,678	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B	5	15	434	5,933	金融
HEXAGON AB-B SHS	10	17	728	9,941	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	13	278	3,797	金融
スウェーデン・クローネ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	791 29銘柄	1,627.18 31銘柄	24,446 < 1.1%>	
ユーロ (アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIB GROUP PLC	-	90	49	6,582	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,570	52.34	39	5,274	金融
KERRY GROUP PLC-A	5.5	12.66	115	15,484	生活必需品
CRH PLC	26.5	50.5	158	21,237	素材
PADDY POWER BETFAIR PLC	2	4.6	46	6,197	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,604 4銘柄	210.1 5銘柄	408 < 0.2%>	
ユーロ (オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N.V.	4	12.99	35	4,711	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	32.5	59.5	197	26,523	ヘルスケア
NN GROUP NV	7	22.5	83	11,267	金融
UNILEVER NV-CVA	47	112.44	528	70,952	生活必需品
HEINEKEN NV	8.6	18.65	167	22,468	生活必需品
RELX NV	32.45	64	121	16,274	資本財・サービス
AEGON NV	86	143.61	79	10,668	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	37.24	88.76	161	21,737	生活必需品
AKZO NOBEL	10	17.25	129	17,346	素材
KONINKLIJKE DSM NV	6	14.59	120	16,152	素材
WOLTERS KLUWER	9.5	23.76	106	14,251	資本財・サービス
BOSKALIS WESTMINSTER	1	9.1	28	3,883	資本財・サービス
ING GROEP NV	115	264.15	421	56,572	金融
KONINKLIJKE KPN NV	56	239	69	9,300	電気通信サービス
ASML HOLDING NV	12.4	25.27	387	52,000	情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA	13	24	66	8,908	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		期 首		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
VOPAK		—	6.3	23	3,115	エネルギー
RANDSTAD HOLDING NV		3	7.5	42	5,648	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		2	6	51	6,851	生活必需品
GEMALTO		2	—	—	—	情報技術
ALTICE NV — A		13.5	33.5	34	4,693	一般消費財・サービス
ALTICE NV — B		1	—	—	—	一般消費財・サービス
AIRBUS SE		17.5	39.97	347	46,598	資本財・サービス
EXOR NV		4.5	10.88	64	8,592	金融
CNH INDUSTRIAL NV		46.5	73.53	87	11,791	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		42	70.44	130	17,458	一般消費財・サービス
FERRARI NV		4.5	8.3	79	10,681	一般消費財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	614.19 26銘柄	1,395.99 25銘柄	3,565	478,450	< 1.6%>
ユーロ (ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UCB SA		3	7	48	6,481	ヘルスケア
KBC GROEP NV		9.5	17.34	127	17,079	金融
COLRUYT SA		3.5	3.5	15	2,073	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		4	4	37	5,070	金融
SOLVAY SA		3	5.36	64	8,602	素材
UMICORE		2	16	70	9,440	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		24.2	53.07	508	68,173	生活必需品
AGEAS		3	16.54	69	9,368	金融
PROXIMUS		7	7	19	2,624	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		—	4.62	28	3,797	一般消費財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	59.2 9銘柄	134.43 10銘柄	988	132,711	< 0.4%>
ユーロ (ルクセンブルグ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
RTL GROUP		—	3.5	24	3,268	一般消費財・サービス
ARCELORMITTAL		56	43.44	129	17,341	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		0.6	0.6	31	4,291	ヘルスケア
SES		19	19	24	3,343	一般消費財・サービス
TENARIS SA		22	22	30	4,053	エネルギー
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	97.6 4銘柄	88.54 5銘柄	240	32,299	< 0.1%>
ユーロ (フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA		—	8.45	30	4,070	一般消費財・サービス
TOTAL SA		67.5	152.31	735	98,717	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		6.5	11.5	149	20,030	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		12.79	28.45	312	41,956	素材
KERING		3.2	5.12	206	27,715	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		19	38.93	289	38,908	資本財・サービス
BOUYGUES SA		5	12.5	56	7,517	資本財・サービス
BNP PARIBAS		34.5	76.75	502	67,386	金融
PEUGEOT SA		11	45.73	83	11,146	一般消費財・サービス
NATIXIS		30	76.74	53	7,202	金融
THALES SA		3	6	54	7,339	資本財・サービス
DANONE		18.5	39.26	279	37,494	生活必需品
CARREFOUR SA		22	51.56	91	12,332	生活必需品
SUEZ		9.5	29.5	42	5,763	公益事業
VIVENDI		27.46	69.25	171	23,045	一般消費財・サービス
L'OREAL		7.9	17.28	325	43,663	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		16.5	32.89	159	21,423	資本財・サービス
LEGRAND SA		8.5	17.5	115	15,508	資本財・サービス

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	千ユーロ	千円	
CASINO GUICHARD PERRACHON	2	2	10	1,384	生活必需品
PERNOD RICARD SA	8.1	15.58	207	27,889	生活必需品
SOCIETE BIC SA	1.5	1.5	14	1,912	資本財・サービス
EURAZEO SA	5	1.59	13	1,753	金融
REXEL SA	16	16	24	3,325	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA	23.5	54.11	244	32,801	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9.3	18.41	453	60,797	一般消費財・サービス
ACCOR SA	3	10	45	6,045	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	6	12.71	132	17,805	情報技術
VALEO SA	6.5	15.12	100	13,443	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	5	13	74	9,939	一般消費財・サービス
BUREAU VERITAS SA	4	17	40	5,470	資本財・サービス
EIFFAGE	4	4	37	5,080	資本財・サービス
SODEXO SA	2	6.69	73	9,852	一般消費財・サービス
IPSEN	—	2.76	29	3,933	ヘルスケア
INGENICO GROUP	2	4.99	46	6,191	情報技術
AMUNDI SA	—	4.37	31	4,245	金融
TELEPERFORMANCE	—	5	63	8,554	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	—	5	34	4,687	情報技術
ZODIAC AEROSPACE	8	21.34	53	7,150	資本財・サービス
FAURECIA	—	5.6	39	5,317	一般消費財・サービス
SEB SA	—	1.97	33	4,430	一般消費財・サービス
ESSILOR INTERNATIONAL	7	14.86	169	22,792	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA	—	0.22	30	4,029	資本財・サービス
AXA SA	57.5	123.65	321	43,198	金融
CHRISTIAN DIOR SE	2.5	—	—	—	一般消費財・サービス
LAGARDERE SCA	—	12	31	4,280	一般消費財・サービス
TECHNIP SA	2	—	—	—	その他
EDENRED	8	19.13	47	6,371	資本財・サービス
RENAULT SA	6	12	107	14,421	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	0.82	2.04	91	12,288	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	—	2.53	28	3,863	生活必需品
ATOS SE	2	6.43	80	10,863	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA	6	8.99	82	11,026	情報技術
WENDEL	—	2.01	29	3,951	金融
ORANGE	66.5	121.29	178	23,949	電気通信サービス
ALSTOM	3.1	13.1	47	6,319	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	—	13.49	27	3,649	金融
SANOFI	36	72.79	540	72,515	ヘルスケア
VINCI SA	17	31.06	275	36,911	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	25	38.63	84	11,367	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	38.5	76.58	114	15,301	金融
BIOMERIEUX	—	4.57	36	4,875	ヘルスケア
ENGIE	56.39	123.26	180	24,281	公益事業
IMERYS SA	—	3.4	28	3,823	素材
EDF	—	34	36	4,852	公益事業
SAFRAN SA	11.5	22.2	199	26,721	資本財・サービス
ILIAD SA	1	2.19	45	6,159	電気通信サービス
ARKEMA	2	4.8	50	6,734	素材
ADP	1	1	16	2,196	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	—	14	25	3,481	一般消費財・サービス
SCOR SE	6	12.97	45	6,121	金融
GETLINK	11	39.4	43	5,879	資本財・サービス

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	
BOLLORE		百株 —	百株 73	千ユーロ 34	千円 4,690	資本財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	775.56 55銘柄	1,864.05 70銘柄	8,496 1,140,157	< 3.8%>	
ユーロ (ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG—REG		25	53.6	574	77,104	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		6	6	19	2,569	素材
DEUTSCHE BANK AG—REGISTERED		48.5	136.93	206	27,764	金融
COMMERZBANK AG		49.9	72.89	91	12,333	金融
VOLKSWAGEN AG		0.5	2.2	39	5,337	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG—PREF		6	11.72	211	28,346	一般消費財・サービス
MAN SE		1	1	9	1,289	資本財・サービス
SIEMENS AG—REG		24	49.62	603	80,967	資本財・サービス
E.ON SE		55.5	162.7	146	19,684	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		11	23.9	215	28,928	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		5.5	13	53	7,161	資本財・サービス
OSRAM LIGHT AG		1.45	6.45	50	6,799	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		3.3	7.5	188	25,291	一般消費財・サービス
BASF SE		28.4	60.62	574	77,034	素材
LINDE AG		7	—	—	—	素材
K+S AG—REG		3	14	30	4,146	素材
ALLIANZ SE—REG		14.6	30.61	613	82,335	金融
THYSENKRUPP AG		15.5	26.3	65	8,826	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		7	14.05	161	21,691	生活必需品
RWE AG		16.5	33.07	58	7,859	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA—REG		—	17	51	6,866	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		—	1.1	10	1,394	資本財・サービス
BRENNTAG AG		8	14.36	78	10,567	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		11	30.86	207	27,861	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG—REG SHARE		4	9.59	56	7,638	情報技術
HOCHTIEF AG		—	1.66	24	3,283	資本財・サービス
SAP SE		28.5	64.24	612	82,246	情報技術
MUEBENCHER RUECKVER AG—REG		4.5	10.36	193	25,948	金融
SCHAEFFLER AG		—	21.02	32	4,315	一般消費財・サービス
ZALANDO SE		—	7	31	4,180	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		6	9	84	11,371	素材
KION GROUP AG		—	6	46	6,210	資本財・サービス
WIRECARD AG		—	10	105	14,089	情報技術
COVESTRO AG		4	8.03	70	9,516	素材
INNOGY SE		6	6	19	2,677	公益事業
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG—PRF		8	12.65	95	12,856	一般消費財・サービス
METRO AG		—	15	25	3,462	生活必需品
DRILLISCH AG		—	5	36	4,834	電気通信サービス
LINDE AG — TENDER		—	13.3	281	37,836	素材
BEIERSDORF AG		5	8.15	81	10,941	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE —PREF		—	7	31	4,211	素材
MERCK KGAA		5.7	8.12	76	10,209	ヘルスケア
ADIDAS AG		6.2	12.57	212	28,531	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		4	6.5	67	9,097	生活必需品
CECONOMY AG		5	—	—	—	一般消費財・サービス
DEUTSCHE TELEKOM AG—REG		95	211.13	316	42,454	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAIMLER AG—REGISTERED SHARES		7.5	17.66	162	21,811	ヘルスケア
INFINEON TECHNOLOGIES AG		31.1	66.01	489	65,690	一般消費財・サービス
HANNOVER RUECK SE		41	84.23	209	28,177	情報技術
		1	3.5	37	5,091	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	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE POST AG—REG		27	66.98	272	36,554	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		—	12.74	126	16,993	金融
DEUTSCHE BOERSE AG—TENDER		7	—	—	—	その他
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE		9	15.6	45	6,160	一般消費財・サービス
LANXESS AG		2	6	41	5,618	素材
MTU AERO ENGINES AG		—	4	62	8,373	資本財・サービス
AXEL SPRINGER SE		—	4.7	31	4,282	一般消費財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE		15.8	23.63	89	12,024	不動産
SYMRISE AG		4	8.3	59	7,996	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		—	62.4	26	3,560	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE—PRF		2.5	2.5	19	2,584	一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG —ORD		3.5	3.5	25	3,426	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		11.5	35.6	150	20,231	不動産
国 小 計		株数、金額 銘柄数<比率>	693.45 48銘柄	1,659.15 60銘柄	8,619 1,156,656 < 3.8%>	
ユーロ (ポルトガル)		百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS		8	8	13	1,802	生活必需品
EDP—ENERGIAS DE PORTUGAL SA		57	151	44	5,981	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		18	36.09	57	7,673	エネルギー
国 小 計		株数、金額 銘柄数<比率>	83 3銘柄	195.09 3銘柄	115 15,458 < 0.1%>	
ユーロ (スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA		148	325.71	272	36,595	電気通信サービス
ENDESA SA		9	21.5	39	5,279	公益事業
BANCO POPULAR ESPANOL		32.41	—	—	—	金融
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		197.89	424.92	308	41,407	金融
IBERDROLA SA		156.06	368.4	243	32,647	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		145.87	325.87	58	7,842	金融
BANKINTER SA		27	67	54	7,331	金融
REPSOL SA		28	83.17	131	17,628	エネルギー
GRIFOLS SA		4	17	45	6,056	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		428.5	1,025.73	584	78,483	金融
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		32.6	48.29	90	12,163	資本財・サービス
AMADEUS IT GROUP SA		14	31.95	203	27,301	情報技術
GAS NATURAL SDG SA		6	21	43	5,776	公益事業
MAPFRE SA		—	80.05	22	3,050	金融
CAIXABANK S.A		143.87	219.87	91	12,223	金融
INTL CONSOLIDATED AIRLINE—DI		49	49	36	4,955	資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		3	21.95	74	9,967	資本財・サービス
AENA SME SA		2	4	71	9,616	資本財・サービス
MASMOVIL IBERCOM SA		156.06	—	—	—	電気通信サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		37.5	69.28	205	27,518	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		—	17.93	22	2,960	資本財・サービス
ENAGAS SA		8	18.59	44	6,019	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA		23	40.56	74	10,063	公益事業
FERROVIAL SA		26	38.76	76	10,207	資本財・サービス
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		32	—	—	—	生活必需品
BANKIA SA		50	72.87	29	4,021	金融
国 小 計		株数、金額 銘柄数<比率>	1,759.76 24銘柄	3,393.4 23銘柄	2,825 379,119 < 1.2%>	
ユーロ (イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA		—	130	25	3,485	金融
PRYSMIAN SPA		4	14.4	41	5,557	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		40.11	96.36	148	19,913	金融

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	千ユーロ	千円	
MEDIOBANCA SPA	11.6	44.6	42	5,730	金融
UNICREDIT SPA	149.33	141.35	232	31,258	金融
TELECOM ITALIA SPA	298	1,085.03	81	10,949	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP	97	483.81	30	4,070	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO-RSP	-	93.84	25	3,465	金融
INTESA SANPAOLO	399.5	837.01	237	31,898	金融
ATLANTIA SPA	14.77	35.27	95	12,807	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	29	29	18	2,510	金融
RECORDATI SPA	-	6.92	26	3,593	ヘルスケア
ENI SPA	72	163.64	237	31,840	エネルギー
LEONARDO SPA	5	25	27	3,626	資本財・サービス
ENEL SPA	248	562.64	299	40,204	公益事業
SNAM SPA	89	162	67	9,004	エネルギー
LUXOTTICA GROUP SPA	8	13.07	67	9,058	一般消費財・サービス
TERNA SPA	37	99	48	6,568	公益事業
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,502.31 15銘柄	4,022.94 18銘柄	1,755 < 0.8%>	235,541
ユーロ（フィンランド）	百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	20.5	44.93	118	15,965	素材
NOKIA OYJ	161	364.94	149	20,112	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	3	8.5	46	6,239	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	20	41.93	57	7,759	素材
METSO OYJ	3	11.08	32	4,424	資本財・サービス
ELISA OYJ	2.5	13	42	5,768	電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS	11	29.29	137	18,437	金融
FORTUM OYJ	7	24	41	5,528	公益事業
KONE OYJ-B	13	26.6	124	16,680	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ	7	7	27	3,679	一般消費財・サービス
NESTE OYJ	4	11	59	8,018	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	5	5	16	2,153	ヘルスケア
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	257 12銘柄	587.27 12銘柄	855 < 0.4%>	114,766
ユーロ（オーストリア）	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	6	12.09	66	8,861	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	10.5	20	75	10,187	金融
VOESTALPINE AG	8	8	42	5,676	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	-	11	35	4,795	金融
ANDRITZ AG	-	5.5	26	3,527	資本財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	24.5 3銘柄	56.59 5銘柄	246 < 0.1%>	33,049
ユーロ（その他）	百株	百株	千ユーロ	千円	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5	-	-	-	生活必需品
STMICROELECTRONICS NV	12	49.17	96	13,004	情報技術
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	17 2銘柄	49.17 1銘柄	96 < 0.0%>	13,004
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	7,487.57 205銘柄	13,656.72 237銘柄	28,213 < 12.5%>	3,785,992
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	37,223.84 1,175銘柄	77,886.52 1,242銘柄	- < 93.4%>	28,401,653

(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) 外国投資信託受益証券

銘 柄	期 首		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	-	70	29	3,306
アメリカ・ドル 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	-	70 1銘柄	29 < 0.0%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の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	期首		当期		期末	
	□ 数	□ 数	評 価	価 額	評 価	価 額
			外貨建金額	邦貨換算金額	外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.372	0.872	150	16,970	150	16,970
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.934	2.094	346	38,977	346	38,977
BOSTON PROPERTIES INC	0.55	1.15	144	16,216	144	16,216
GGP INC	1.7	4	92	10,453	92	10,453
VORNADO REALTY TRUST	0.606	1.156	85	9,584	85	9,584
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	0.8	130	14,712	130	14,712
EQUITY RESIDENTIAL	1	2.25	140	15,775	140	15,775
EQUINIX INC	0.234	0.514	234	26,355	234	26,355
AMERICAN TOWER CORP	1.3	3.1	437	49,169	437	49,169
HOST HOTELS & RESORTS INC	2.728	4.228	86	9,717	86	9,717
KIMCO REALTY CORP	1.8	3.3	56	6,390	56	6,390
PARK HOTELS & RESORTS INC	0.35	—	—	—	—	—
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	3.5	38	4,325	38	4,325
INVITATION HOMES INC	—	2.2	50	5,645	50	5,645
VENTAS INC	1.25	2.7	155	17,515	155	17,515
WEYERHAEUSER CO	2.504	4.904	172	19,444	172	19,444
AGNC INVESTMENT CORP	0.7	2.1	41	4,670	41	4,670
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1.4	1.4	24	2,717	24	2,717
CROWN CASTLE INTL CORP	1.15	2.8	301	33,904	301	33,904
IRON MOUNTAIN INC	0.918	1.718	63	7,115	63	7,115
VEREIT INC	4.35	7.75	58	6,527	58	6,527
PROLOGIS INC	1.465	3.415	213	24,058	213	24,058
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.2	0.7	88	9,943	88	9,943
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.3	0.65	57	6,450	57	6,450
DUKE REALTY CORP	0.8	3.1	81	9,143	81	9,143
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.25	0.45	106	11,955	106	11,955
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.25	0.45	56	6,347	56	6,347
WELLTOWER INC	1.2	2.35	144	16,217	144	16,217
HCP INC	1.2	2.8	68	7,714	68	7,714
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.3	1	41	4,709	41	4,709
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.45	0.7	66	7,478	66	7,478
MACERICH CO/THE	0.3	0.7	44	5,001	44	5,001
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	3.7	9.6	110	12,425	110	12,425
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	0.65	0.65	26	3,000	26	3,000
REALTY INCOME CORP	0.95	1.8	97	10,980	97	10,980
PUBLIC STORAGE	0.45	1.1	221	24,881	221	24,881
REGENCY CENTERS CORP	0.3	1.15	75	8,522	75	8,522
SL GREEN REALTY CORP	0.4	0.65	64	7,209	64	7,209
UDR INC	1.2	1.9	70	7,892	70	7,892
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.55	1.45	163	18,359	163	18,359
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.5	0.8	66	7,476	66	7,476
アメリカ・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	39,261 38銘柄	87,951 40銘柄	4,677 <1.7%>	525,956 <1.7%>	525,956 <1.7%>
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円	千カナダ・ドル	千円
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	—	2	42	3,862	42	3,862
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	—	1.4	34	3,096	34	3,096
カナダ・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	— 2銘柄	3.4 2銘柄	77 <0.0%>	6,959 <0.0%>	6,959 <0.0%>
(オーストラリア)	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円	千オーストラリア・ドル	千円
LENDLEASE GROUP	—	4.303	69	6,095	69	6,095
TRANSURBAN GROUP	—	17.162	211	18,550	211	18,550

銘柄	期首		当期		期末	
	□ 数	□ 数	評 価	価 額	評 価	価 額
			外貨建金額	邦貨換算金額	外貨建金額	邦貨換算金額
	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円	千オーストラリア・ドル	千円
SYDNEY AIRPORT	—	9.129	64	5,679	64	5,679
APA GROUP	—	7.5	61	5,424	61	5,424
SCENTRE GROUP	22.429	30.929	128	11,334	128	11,334
DEXUS	2.5	6.5	66	5,815	66	5,815
GPT GROUP	6.82	14.648	76	6,719	76	6,719
MIRVAC GROUP	13.9	31.638	73	6,478	73	6,478
STOCKLAND	6.1	14.3	63	5,579	63	5,579
WESTFIELD CORP	5.6	13.956	130	11,467	130	11,467
GOODMAN GROUP	8.8	14.731	124	10,900	124	10,900
VICINITY CENTRES	19.523	19.523	53	4,666	53	4,666
オーストラリア・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	85,672 8銘柄	184,319 12銘柄	1,123 <0.3%>	98,711 <0.3%>	98,711 <0.3%>
(香港)	千□	千□	千香港ドル	千円	千香港ドル	千円
LINK REIT	9.5	13.5	1,002	14,414	1,002	14,414
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	—	34	344	4,947	344	4,947
香港・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	9.5 1銘柄	47.5 2銘柄	1,346 <0.1%>	19,362 <0.1%>	19,362 <0.1%>
(シンガポール)	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	28	55	4,665	55	4,665
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	12	12	33	2,807	33	2,807
CAPITALAND MALL TRUST	9	9	18	1,590	18	1,590
SUNTEC REIT	—	26	57	4,813	57	4,813
シンガポール・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	21 2銘柄	75 4銘柄	164 <0.0%>	13,877 <0.0%>	13,877 <0.0%>
(イギリス)	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	3.05	4.808	47	7,293	47	7,293
SEGRO PLC	1.52	5.92	34	5,291	34	5,291
HAMMERSON PLC	1.2	4.9	26	3,973	26	3,973
BRITISH LAND CO PLC	2.3	6.3	43	6,572	43	6,572
イギリス・ポンド 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	8.07 4銘柄	21,928 4銘柄	152 <0.1%>	23,131 <0.1%>	23,131 <0.1%>
(ユーロ (フランス))	千□	千□	千ユーロ	千円	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO SE	0.37	0.609	128	17,292	128	17,292
ICADE	—	0.406	33	4,551	33	4,551
GECINA SA	0.14	0.334	52	7,009	52	7,009
KLEPIERRE	0.6	1.4	50	6,812	50	6,812
FONCIERE DES REGIONS	—	0.353	32	4,417	32	4,417
ユーロ通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	1.11 3銘柄	3,102 5銘柄	298 <0.1%>	40,083 <0.1%>	40,083 <0.1%>
合 計	□数、金額 銘柄数<比率>	164,613 56銘柄	423,2 69銘柄	— <2.4%>	728,082 <2.4%>	728,082 <2.4%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年1月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 28,401,653	% 92.4
投資信託受益証券	3,306	0.0
投資信託証券	728,082	2.4
コール・ローン等、その他	1,588,474	5.2
投資信託財産総額	30,721,516	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、1月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝112.45円、1カナダ・ドル＝90.17円、1オーストラリア・ドル＝87.88円、1香港ドル＝14.38円、1シンガポール・ドル＝84.16円、1ニュージーランド・ドル＝80.39円、1イギリス・ポンド＝152.16円、1イスラエル・シケル＝32.66円、1スイス・フラン＝114.30円、1デンマーク・クローネ＝18.02円、1ノルウェー・クローネ＝13.86円、1スウェーデン・クローネ＝13.65円、1ユーロ＝134.19円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産（29,642,904千円）の投資信託財産総額（30,721,516千円）に対する比率は、96.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年1月10日現在

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

* 期首における元本額は7,765,887,299円、当期中における追加設定元本額は10,800,317,302円、同解約元本額は2,393,707,684円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）13,970,698,284円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）758,224,939円、i F r e e 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）61,139,199円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 510,459,045円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 858,309,210円、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）13,666,240円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は18,797円です。

■損益の状況

当期 自2017年1月11日 至2018年1月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	479,925,634円
受取配当金	477,451,868
受取利息	182,523
その他収益金	2,536,236
支払利息	△ 244,993
(B) 有価証券売買損益	3,339,703,704
売買益	6,181,353,946
売買損	△ 2,841,650,242
(C) 先物取引等損益	149,040,753
取引益	162,361,450
取引損	△ 13,320,697
(D) その他費用	△ 22,094,118
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	3,946,575,973
(F) 前期繰越損益金	4,535,975,077
(G) 解約差損益金	△ 1,752,354,816
(H) 追加信託差損益金	7,496,423,531
(I) 合計(E + F + G + H)	14,226,619,765
次期繰越損益金(I)	14,226,619,765

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

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

ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券	
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式（預託証券を含みます。）	
マザーファンドの運用方法	①主として外国の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。		
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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

運用報告書(全体版) 第2期 (決算日 2018年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

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

設定以来の運用実績

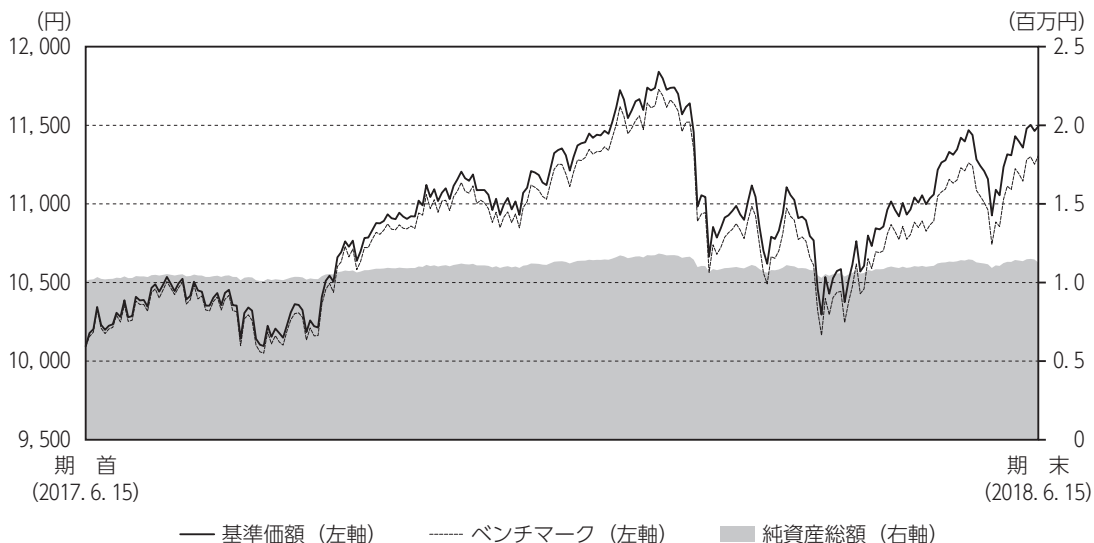
決 算 期	基 準 価 額			MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6 月15日)	10, 094	100	1. 9	10, 127	1. 3	97. 0	1. 4	2. 6	1
2 期末 (2018年 6 月15日)	11, 273	220	13. 9	11, 344	12. 0	97. 9	1. 5	2. 4	1

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (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 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) 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) 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 1）期末の基準価額は分配金込みです。

（注 2）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ベース）です。

基準価額・騰落率

期 首：10,094円

期 末：11,273円（分配金220円）

騰落率：13.9%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

ベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ベース））の動きをほぼ反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

年 月 日	基 準 価 額		M S C I コクサイ指数 (円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期首) 2017年 6 月15日	円	%		%	%	%	%
	10, 094	—	10, 127	—	97. 0	1. 4	2. 6
6 月末	10, 279	1. 8	10, 286	1. 6	95. 9	1. 5	2. 5
7 月末	10, 353	2. 6	10, 359	2. 3	95. 8	1. 7	2. 6
8 月末	10, 310	2. 1	10, 297	1. 7	95. 2	2. 1	2. 7
9 月末	10, 786	6. 9	10, 757	6. 2	96. 3	1. 2	2. 6
10月末	11, 031	9. 3	10, 994	8. 6	95. 8	1. 6	2. 6
11月末	11, 103	10. 0	11, 051	9. 1	95. 5	1. 8	2. 6
12月末	11, 446	13. 4	11, 377	12. 3	95. 5	2. 0	2. 6
2018年 1 月末	11, 570	14. 6	11, 498	13. 5	95. 7	1. 9	2. 4
2 月末	11, 045	9. 4	10, 961	8. 2	95. 9	1. 8	2. 3
3 月末	10, 573	4. 7	10, 472	3. 4	95. 6	2. 0	2. 5
4 月末	11, 041	9. 4	10, 920	7. 8	96. 3	1. 4	2. 4
5 月末	11, 090	9. 9	10, 920	7. 8	95. 7	1. 8	2. 4
(期末) 2018年 6 月15日	11, 493	13. 9	11, 344	12. 0	97. 9	1. 5	2. 4

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

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

■外国株式市況

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

■為替相場

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

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

外国株式を中心に、S & P 500先物取引も一部利用し、株式組入比率（リート、株式先物を含む。）につきましては、期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

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

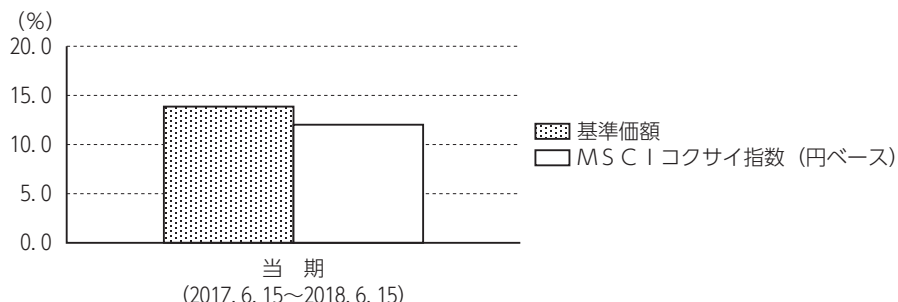
ベンチマークとの差異について

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

当ファンドが、組み入れているマザーファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないことが、かい離要因となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は220円といたしました。

収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年6月16日 ～2018年6月15日	
当期分配金（税込み）（円）		220
対基準価額比率（％）		1.91
当期の収益（円）		220
当期の収益以外（円）		—
翌期繰越分配対象額（円）		1,273

（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。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	229.13円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,170.18
(c) 収益調整金	0.00
(d) 分配準備積立金	93.77
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	1,493.08
(f) 分配金	220.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	1,273.08

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 6. 16～2018. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	48円	0. 437%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10, 899円です。
(投 信 会 社)	(34)	(0. 308)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(12)	(0. 108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0. 022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0. 003	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0. 003)	
(先 物)	(0)	(0. 000)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
有価証券取引税	1	0. 006	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0. 006)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	10	0. 088	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(6)	(0. 051)	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)	(4)	(0. 033)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0. 004)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	58	0. 534	

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

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式 インデックス マザーファンド	—	—	6	15

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

項 目	当 期
	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	12,346,089千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	90,461,983千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.13

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■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

期首保有額	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

(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	期 首			当 期 末	
	□ 数	□ 数	□ 数	□ 数	評 価 額
		千口		千口	千円
外国株式インデックス マザーファンド		470		463	1,149

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス マザーファンド	1,149	99.8
コール・ローン等、その他	2	0.2
投資信託財産総額	1,151	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

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

(注3) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（103,482,398千円）の投資信託財産総額（103,704,052千円）に対する比率は、99.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,151,829円
コール・ローン等	2,548
外国株式インデックス マザーファンド（評価額）	1,149,181
未収入金	100
(B) 負債	24,521
未払収益分配金	22,000
未払信託報酬	2,339
その他未払費用	182
(C) 純資産総額（A－B）	1,127,308
元本	1,000,000
次期繰越損益金	127,308
(D) 受益権総口数	1,000,000口
1万口当り基準価額（C/D）	11,273円

* 期首における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は0円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,273円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	144,904円
売買益	144,905
売買損	△ 1
(B) 信託報酬等	△ 4,973
(C) 当期損益金 (A + B)	139,931
(D) 前期繰越損益金	9,377
(E) 合計 (C + D)	149,308
(F) 収益分配金	△ 22,000
次期繰越損益金 (E + F)	127,308
分配準備積立金	127,308

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

(注2) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	22,913円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	117,018
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	9,377
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	149,308
(f) 分配金	22,000
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	127,308
(h) 受益権総口数	1,000,000口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	220円

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用））が投資対象としている「外国株式インデックスマザーファンド」の決算日（2017年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15日）現在における外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を122～149ページに併せて掲載いたしました。

■外国株式インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年6月15日現在における外国株式インデックスマザーファンド（41,775,947千口）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	2018年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	28.5	327	36,240	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	22	474	52,487	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	48	293	32,523	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	14.5	256	28,442	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	188	662	73,368	金融
ABBOTT LABORATORIES	427.66	2,692	298,011	ヘルスケア
ARCONIC INC	103.33	185	20,585	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	39	428	47,468	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	96	773	85,639	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	74.5	679	75,200	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	80.79	870	96,321	情報技術
QORVO INC	31	259	28,700	情報技術
AFLAC INC	190	867	96,061	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	29.5	271	30,100	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	35	162	18,032	一般消費財・サービス
ADOBE SYSTEMS INC	119.5	3,084	341,369	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	55	247	27,344	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
LULULEMON ATHLETICA INC		26	327	36,224	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL		80	150	16,637	金融
GARMIN LTD		29	179	19,881	一般消費財・サービス
AETNA INC		78.79	1,481	164,023	ヘルスケア
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC		53.5	886	98,129	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC		184	2,782	307,920	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC		41.71	363	40,227	情報技術
WR BERKLEY CORP		23	173	19,163	金融
AUTOZONE INC		6.6	450	49,891	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC		57.21	505	55,936	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR		225	535	59,219	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL		26.5	199	22,117	公益事業
CELANESE CORP-SERIES A		33	379	42,039	素材
DR HORTON INC		87.16	375	41,558	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK		24.5	157	17,425	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC		54.5	244	27,077	ヘルスケア
AUTODESK INC		55	761	84,255	情報技術
MOODY'S CORP		42.5	747	82,755	金融
DEVON ENERGY CORP		124.5	519	57,474	エネルギー
ALBEMARLE CORP		28	262	29,025	素材
ATMOS ENERGY CORP		25	214	23,707	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP		57.5	227	25,214	公益事業
CITIGROUP INC		644.73	4,265	472,109	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING		108.5	1,517	167,906	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER		121	781	86,540	公益事業
ALLEGHANY CORP		3.7	215	23,817	金融
DOMINO'S PIZZA INC		11	301	33,316	一般消費財・サービス
HESS CORP		72	438	48,586	エネルギー
DAVITA INC		35	248	27,519	ヘルスケア
DANAHER CORP		154	1,580	174,947	ヘルスケア
FORTIVE CORP		75	600	66,515	資本財・サービス
AVNET INC		28	112	12,451	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN		141.5	1,054	116,707	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A		49	115	12,728	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		47.28	102	11,371	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		136	615	68,097	生活必需品
BUNGE LTD		36	253	28,110	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD		85.25	846	93,703	情報技術
APPLE INC		1,250	23,850	2,639,718	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		90	676	74,908	金融
BOEING CO/THE		137.9	4,997	553,153	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP		39.15	269	29,863	金融
BECTON DICKINSON AND CO		65.39	1,522	168,500	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR		60	178	19,789	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC		35.5	215	23,869	情報技術
CDK GLOBAL INC		29	190	21,139	情報技術
NISOURCE INC		85	203	22,569	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		33.5	302	33,529	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		251.71	1,429	158,240	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC		1,004.54	4,803	531,674	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		309.5	5,957	659,417	金融
ANSYS INC		21	371	41,121	情報技術
H&R BLOCK INC		51	121	13,417	一般消費財・サービス
BB&T CORP		192.5	1,009	111,728	金融

銘柄	株数	2018年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	401	2,150	238,024	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	845.2	9,130	1,010,585	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	60	741	82,120	金融
CIGNA CORP	60.5	1,060	117,403	ヘルスケア
LKQ CORP	78	258	28,618	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	10	123	13,718	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	64.62	342	37,863	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	67.5	303	33,574	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	36.1	533	58,994	金融
DOLLAR GENERAL CORP	66.5	640	70,900	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	42.5	787	87,182	情報技術
CATERPILLAR INC	144.5	2,212	244,920	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	67.5	294	32,588	公益事業
MOSAIC CO/THE	90.5	266	29,528	素材
DELTA AIR LINES INC	43.5	238	26,432	資本財・サービス
CORNING INC	213	615	68,107	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,204	5,380	595,533	情報技術
MORGAN STANLEY	330	1,693	187,406	金融
WABCO HOLDINGS INC	12.5	153	17,012	資本財・サービス
MSCI INC	21.5	370	41,012	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	9	190	21,069	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	13	138	15,276	資本財・サービス
COTY INC-CL A	118.39	168	18,685	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	52	275	30,514	情報技術
BROADCOM INC	100.02	2,685	297,190	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	10.5	119	13,268	ヘルスケア
ACUITY BRANDS INC	10	120	13,366	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	21.8	233	25,831	ヘルスケア
ARAMARK	58.5	232	25,743	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	53.5	166	18,474	素材
DTE ENERGY COMPANY	43.5	422	46,725	公益事業
CENTENE CORP	50.5	623	69,028	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	28	290	32,171	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	121.5	503	55,673	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	43	283	31,401	金融
GARTNER INC	22	302	33,429	情報技術
SPLUNK INC	33.5	400	44,307	情報技術
AGCO CORP	14.5	89	9,900	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC	157.5	1,031	114,215	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	105.5	591	65,448	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	36.5	233	25,842	資本財・サービス
DEERE & CO	75	1,126	124,664	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	38	447	49,523	情報技術
TIME WARNER INC	190.33	1,879	208,066	一般消費財・サービス
VMWARE INC-CLASS A	18	270	29,933	情報技術
CHEMOURS CO/THE	45.5	226	25,068	素材
NASDAQ INC	29	274	30,418	金融
VAIL RESORTS INC	9.5	267	29,554	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	36.5	256	28,351	金融
TARGA RESOURCES CORP	53.5	259	28,730	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	16.5	236	26,204	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	18	197	21,868	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	10.5	117	13,049	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	75.5	553	61,210	公益事業

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2018年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
COGNEX CORP	41.5	189	21,027	情報技術
TELEFLEX INC	11.3	321	35,539	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	21	272	30,134	資本財・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	27.5	228	25,271	ヘルスケア
IDEX CORP	19.5	280	31,007	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	204.5	1,294	143,296	生活必需品
ROLLINS INC	25.5	133	14,752	資本財・サービス
AMETEK INC	57.75	432	47,836	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	61	303	33,622	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	32	133	14,808	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	31	346	38,311	資本財・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A	82.5	941	104,231	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	106.5	2,184	241,783	生活必需品
SCANA CORP	31	114	12,660	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	13.5	209	23,235	金融
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6	276	30,576	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	76	171	18,934	金融
UGI CORP	42	206	22,894	公益事業
CUMMINS INC	38.5	546	60,461	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	175.5	1,363	150,946	情報技術
SABRE CORP	51	134	14,907	情報技術
CDW CORP/DE	37.5	314	34,797	情報技術
SIGNATURE BANK	13	163	18,138	金融
COSTAR GROUP INC	9	368	40,811	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	13	411	45,537	金融
AMERCO	1.7	59	6,624	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15	240	26,609	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	10	305	33,757	情報技術
HANESBRANDS INC	85	171	18,975	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	19.5	255	28,292	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	70.66	585	64,856	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	46	139	15,411	情報技術
IPG PHOTONICS CORP	9	217	24,022	情報技術
COPART INC	54	313	34,712	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	24.5	284	31,441	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	26	170	18,845	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	18.7	684	75,807	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	12.8	440	48,758	資本財・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	90	283	31,407	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	487.81	826	91,514	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	68	720	79,785	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	111.5	263	29,136	エネルギー
T-MOBILE US INC	85.5	508	56,334	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	25	162	18,010	情報技術
COCA-COLA CO/THE	986	4,296	475,590	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	53	209	23,170	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	42.5	326	36,111	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	27.5	150	16,706	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	79.5	263	29,168	金融
CSX CORP	214	1,410	156,063	資本財・サービス
FLUOR CORP	33	161	17,856	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	24.5	460	50,946	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	30.25	373	41,375	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	21.5	342	37,864	一般消費財・サービス

銘柄	株数	2018年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AMAZON.COM INC	100.7	17,359	1,921,324	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	55.5	153	17,027	エネルギー
FLOWSERVE CORP	32	132	14,712	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	52	788	87,228	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,031.05	8,443	934,500	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	34	184	20,433	情報技術
AES CORP	156	205	22,756	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	19	375	41,587	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	10.2	230	25,513	金融
EOG RESOURCES INC	141.5	1,663	184,066	エネルギー
EQT CORP	62.5	351	38,848	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	41.5	335	37,140	情報技術
ABIOMED INC	10.8	475	52,672	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	40	373	41,327	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	79.9	529	58,640	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	897.23	1,066	118,074	一般消費財・サービス
MACY'S INC	74.98	281	31,170	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	34.4	87	9,708	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48.87	143	15,929	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC-C	72.89	176	19,482	一般消費財・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	34	185	20,527	資本財・サービス
FORTINET INC	35	230	25,466	情報技術
MARKEL CORP	3.4	373	41,390	金融
NEXTERA ENERGY INC	114.5	1,818	201,270	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	341.08	599	66,365	素材
US BANCORP	403.5	2,055	227,450	金融
UNITED RENTALS INC	21.5	353	39,135	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	16	290	32,166	情報技術
FASTENAL CO	72	380	42,068	資本財・サービス
FISERV INC	102.5	783	86,707	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	2,116.5	2,886	319,522	資本財・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	41	231	25,598	ヘルスケア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	52	283	31,337	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	60.5	151	16,807	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	313	1,363	150,938	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	27.5	158	17,571	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	62	1,214	134,374	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	87.4	2,042	226,019	金融
ALPHABET INC-CL A	72.6	8,422	932,191	情報技術
ALPHABET INC-CL C	76.87	8,856	980,220	情報技術
OWENS CORNING	27.5	179	19,844	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	140.5	625	69,215	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	110.68	379	41,980	公益事業
GENUINE PARTS CO	35	329	36,440	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	96.34	489	54,124	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	176	542	60,075	金融
HARRIS CORP	28.5	427	47,299	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	30	129	14,304	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	210.5	1,004	111,202	エネルギー
HOME DEPOT INC	284.5	5,680	628,730	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	12.5	119	13,248	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	272	419	46,421	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	10.9	239	26,535	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	35	322	35,693	生活必需品

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
HARLEY-DAVIDSON INC		40	176	19,568	一般消費財・サービス
HUMANA INC		35	1,065	117,930	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV		82	926	102,565	情報技術
HELMERICH & PAYNE		26	168	18,696	エネルギー
HENRY SCHEIN INC		38	276	30,652	ヘルスケア
HP INC		402	956	105,894	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE		394	623	68,987	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C		43	200	22,168	一般消費財・サービス
HOLLYFRONTIER CORP		43	313	34,723	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C		49	163	18,103	一般消費財・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A		21	97	10,777	一般消費財・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD		31	251	27,836	金融
KRAFT HEINZ CO/THE		149.03	904	100,072	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP		223.5	3,245	359,180	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO		94.5	537	59,450	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI		36	204	22,631	資本財・サービス
ZOETIS INC		118	1,040	115,126	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC		62.79	577	63,873	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC		50.5	327	36,291	エネルギー
ALLEGION PLC		24.5	200	22,178	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC		31	137	15,182	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C		136.73	393	43,523	一般消費財・サービス
WASTE CONNECTIONS INC		64.57	492	54,564	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC		89	247	27,404	情報技術
JM SMUCKER CO/THE		27.2	282	31,233	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON		654	8,005	886,061	ヘルスケア
ABBVIE INC		389.79	3,849	426,026	ヘルスケア
HOLOGIC INC		65.5	263	29,164	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP		86.5	882	97,691	生活必需品
KROGER CO		218.5	571	63,264	生活必需品
KLA-TENCOR CORP		38.5	435	48,206	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP		63	1,956	216,569	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		22	452	50,045	情報技術
L BRANDS INC		59	212	23,501	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC		202.5	2,007	222,244	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO		242	2,089	231,284	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP		40.3	730	80,809	情報技術
JONES LANG LASALLE INC		11	187	20,758	不動産
LOEWS CORP		72.5	359	39,808	金融
LINCOLN NATIONAL CORP		54.49	370	41,040	金融
MCDONALD'S CORP		193	3,224	356,839	一般消費財・サービス
3M CO		145.5	2,962	327,924	資本財・サービス
FACEBOOK INC-A		586	11,533	1,276,479	情報技術
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V		51.04	448	49,661	情報技術
MANPOWERGROUP INC		16	148	16,481	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC		61.5	1,274	141,098	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS		15	345	38,217	素材
CONCHO RESOURCES INC		36	458	50,702	エネルギー
FIRST DATA CORP- CLASS A		111.5	240	26,668	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC		53	193	21,446	電気通信サービス
PHILLIPS 66		109.5	1,265	140,040	エネルギー
TECHNIPFMC PLC		111.5	358	39,688	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL		134	421	46,614	一般消費財・サービス
MATTEL INC		87	155	17,255	一般消費財・サービス

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
DXC TECHNOLOGY CO		70.38	594	65,783	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		30	317	35,149	生活必需品
MYLAN NV		128.5	507	56,192	ヘルスケア
METLIFE INC		219	1,024	113,365	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD		111	241	26,733	情報技術
ARISTA NETWORKS INC		12.9	362	40,137	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A		38	177	19,595	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC		40.28	458	50,778	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL		6.4	379	41,984	ヘルスケア
BAKER HUGHES A GE CO		102.73	345	38,294	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC		30.8	551	60,999	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC		19.4	87	9,718	金融
MERCK & CO. INC.		664.71	4,091	452,897	ヘルスケア
DOWDUPONT INC		571.05	3,904	432,187	素材
MASCO CORP		79	303	33,593	資本財・サービス
M & T BANK CORP		35.19	614	68,046	金融
MARSH & MCLENNAN COS		123	1,007	111,550	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A		74.72	1,036	114,746	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A		33	423	46,824	情報技術
SQUARE INC - A		70.5	450	49,845	情報技術
TRANSUNION		44	313	34,712	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP		87	208	23,119	公益事業
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD		38.5	253	28,059	一般消費財・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A		72.5	611	67,652	情報技術
NETAPP INC		64.5	499	55,326	情報技術
NIKE INC -CL B		322	2,405	266,223	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP		69	1,058	117,203	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		56.5	579	64,141	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		32	315	34,868	金融
ALLY FINANCIAL INC		107	281	31,193	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP		40.3	1,299	143,874	資本財・サービス
APTIV PLC		65	666	73,819	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP		130	509	56,344	素材
MCKESSON CORP		50.5	757	83,840	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		71	436	48,273	情報技術
XYLEM INC		45	322	35,725	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		379	3,064	339,147	生活必需品
NUCOR CORP		77	527	58,403	素材
WESTERN UNION CO		117.46	242	26,858	情報技術
GODADDY INC - CLASS A		36	264	29,305	情報技術
NEWELL BRANDS INC		122.92	324	35,903	一般消費財・サービス
EVERGY INC		34.5	179	19,836	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		187	1,577	174,580	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C		25.5	195	21,590	一般消費財・サービス
PAYCHEX INC		78.5	544	60,245	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		21.2	597	66,143	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC		464	2,630	291,185	生活必需品
P G & E CORP		125	498	55,187	公益事業
PFIZER INC		1,451.63	5,249	580,969	ヘルスケア
ALKERMES PLC		36	180	19,978	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC		124	531	58,836	公益事業
STRYKER CORP		82	1,383	153,153	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP		33	567	62,789	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO		41.5	794	87,937	エネルギー

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	2018年6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
POLARIS INDUSTRIES INC		14	181	20,035	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE		618.17	4,697	519,916	生活必需品
EXELON CORP		232.22	953	105,558	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC		55	660	73,146	ヘルスケア
NVR INC		0.9	280	31,025	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS		293	1,996	220,940	エネルギー
PEPSICO INC		347	3,648	403,761	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		102.5	1,012	112,028	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC		42.5	339	37,527	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A		149	2,425	268,412	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD		19.5	110	12,226	金融
PENTAIR PLC		42.05	184	20,375	資本財・サービス
QUALCOMM INC		362.5	2,155	238,562	情報技術
INVESCO LTD		101.5	276	30,567	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC		19	253	28,073	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		72	405	44,833	金融
RAYTHEON COMPANY		71.2	1,443	159,720	資本財・サービス
RED HAT INC		43	756	83,715	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS		19	599	66,382	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC		56	387	42,909	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC		11.8	2,505	277,276	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC		93	785	86,977	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA		24	289	32,083	素材
RESMED INC		34	362	40,175	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC		33	366	40,520	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC		30.5	213	23,606	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP		13	180	20,012	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC		39.63	546	60,477	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP		288.35	536	59,424	金融
CHEVRON CORP		462.68	5,853	647,850	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL		78.5	472	52,304	公益事業
TESLA INC		33	1,180	130,655	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP		150.5	321	35,580	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC		37.22	529	58,616	資本財・サービス
SYNOPSIS INC		37.5	340	37,715	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		45.05	1,331	147,395	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A		75	362	40,093	不動産
TWITTER INC		168	785	86,946	情報技術
SOUTHERN CO/THE		245	1,083	119,882	公益事業
SYSCO CORP		122	811	89,767	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE		66.23	853	94,458	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY		32	210	23,272	金融
STERICYCLE INC		21.5	138	15,279	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC		57	279	30,919	素材
SCHLUMBERGER LTD		336.52	2,299	254,502	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		41.5	223	24,720	資本財・サービス
AT&T INC		1,495.41	4,863	538,244	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO		36.5	189	20,982	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP		110	284	31,520	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE		20.4	818	90,585	素材
SEMPRA ENERGY		58	657	72,745	公益事業
TIFFANY & CO		29.5	400	44,297	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY		70.5	416	46,099	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC		241	2,764	306,002	情報技術

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
SALESFORCE.COM INC	166.5	2,304	255,064	情報技術	
WESTROCK CO	61.8	373	41,382	素材	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	222.84	777	86,052	資本財・サービス	
ANDEAVOR	36.5	507	56,161	エネルギー	
UNION PACIFIC CORP	190.5	2,761	305,599	資本財・サービス	
MARATHON OIL CORP	213	449	49,790	エネルギー	
MARATHON PETROLEUM CORP	119	894	99,032	エネルギー	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	184	2,335	258,514	資本財・サービス	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	167.5	1,962	217,257	資本財・サービス	
UNUM GROUP	54	209	23,207	金融	
SPRINT CORP	207.65	113	12,548	電気通信サービス	
ANTERO RESOURCES CORP	51	100	11,153	エネルギー	
IQVIA HOLDINGS INC	39.44	406	45,031	ヘルスケア	
VOYA FINANCIAL INC	43.5	224	24,891	金融	
AMEREN CORPORATION	58	326	36,186	公益事業	
UNITEDHEALTH GROUP INC	236.26	6,032	667,668	ヘルスケア	
VERISIGN INC	21.5	303	33,604	情報技術	
VALERO ENERGY CORP	105.92	1,237	136,950	エネルギー	
ULTA BEAUTY INC	14.1	347	38,484	一般消費財・サービス	
FNF GROUP	68.38	261	28,918	金融	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	21	240	26,633	ヘルスケア	
ANTHEM INC	62.9	1,520	168,293	ヘルスケア	
WALT DISNEY CO/THE	368.5	4,007	443,543	一般消費財・サービス	
WELLS FARGO & CO	1,139.72	6,238	690,513	金融	
WASTE MANAGEMENT INC	106.5	890	98,507	資本財・サービス	
WILLIAMS COS INC	200	544	60,232	エネルギー	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	32	237	26,322	一般消費財・サービス	
WHIRLPOOL CORP	17	264	29,252	一般消費財・サービス	
WALMART INC	364.5	3,054	338,032	生活必需品	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	29	256	28,335	資本財・サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	50.5	580	64,210	ヘルスケア	
WYNN RESORTS LTD	24	423	46,817	一般消費財・サービス	
XEROX CORP	52.11	144	15,999	情報技術	
WABTEC CORP	20.5	209	23,145	資本財・サービス	
TJX COMPANIES INC	156.5	1,479	163,791	一般消費財・サービス	
WATERS CORP	19	380	42,115	ヘルスケア	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	18	131	14,547	資本財・サービス	
ALLERGAN PLC	82.07	1,427	158,007	ヘルスケア	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	211	1,368	151,494	生活必需品	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	31.33	488	54,108	金融	
WESTERN DIGITAL CORP	73	602	66,697	情報技術	
WEC ENERGY GROUP INC	78.3	468	51,876	公益事業	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	122	637	70,512	公益事業	
VISA INC-CLASS A SHARES	442	5,967	660,427	情報技術	
PPL CORP	167	452	50,034	公益事業	
PULTEGROUP INC	62.5	192	21,305	一般消費財・サービス	
PPG INDUSTRIES INC	61.5	639	70,763	素材	
NORTHERN TRUST CORP	53.5	572	63,329	金融	
NVIDIA CORP	148	3,950	437,215	情報技術	
IAC/INTERACTIVECORP	18.5	300	33,224	情報技術	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	116.43	1,651	182,781	金融	
QURATE RETAIL INC	114.5	245	27,183	一般消費財・サービス	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	47	203	22,519	資本財・サービス	
TYSON FOODS INC-CL A	74.5	528	58,535	生活必需品	

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
NETFLIX INC		105. 5	4, 144	458, 744	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		97. 5	2, 111	233, 685	ヘルスケア
TORCHMARK CORP		26. 75	225	24, 929	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA		39. 5	395	43, 744	金融
TEXTRON INC		63. 5	428	47, 433	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A		258. 5	1, 152	127, 546	一般消費財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B		110	488	54, 080	一般消費財・サービス
NEWS CORP - CLASS A		92. 37	147	16, 378	一般消費財・サービス
OGE ENERGY CORP		47	162	17, 977	公益事業
OMNICOM GROUP		57	429	47, 549	一般消費財・サービス
ORACLE CORP		763. 33	3, 503	387, 787	情報技術
MASTERCARD INC - A		229	4, 564	505, 165	情報技術
ONEOK INC		102. 5	710	78, 664	エネルギー
CENTURYLINK INC		239. 52	431	47, 744	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC		25	708	78, 364	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC		83	692	76, 596	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE		28. 5	347	38, 432	情報技術
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP		12. 3	278	30, 830	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B		46	306	33, 969	生活必需品
NOBLE ENERGY INC		116	401	44, 384	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP		2, 413. 01	7, 118	787, 862	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		43	386	42, 823	ヘルスケア
NORDSTROM INC		30	149	16, 558	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO		179. 5	1, 790	198, 193	金融
ANALOG DEVICES INC		88. 99	905	100, 168	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES		228	370	41, 006	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP		68	407	45, 149	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP		217. 22	1, 190	131, 749	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP		135	959	106, 146	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC		45	458	50, 787	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		42	476	52, 761	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO		51	148	16, 482	エネルギー
AVERY DENNISON CORP		21	223	24, 700	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A		145. 5	1, 142	126, 496	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO		157	1, 144	126, 676	資本財・サービス
AON PLC		60. 5	848	93, 886	金融
AMGEN INC		172. 5	3, 204	354, 715	ヘルスケア
TAPESTRY INC		71	323	35, 778	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC		107. 36	851	94, 205	資本財・サービス
CELGENE CORP		192	1, 505	166, 583	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A		41. 8	970	107, 416	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC		263	1, 306	144, 641	情報技術
CIT GROUP INC		33	169	18, 751	金融
CIMAREX ENERGY CO		22. 5	194	21, 553	エネルギー
CME GROUP INC		84	1, 418	156, 991	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC		92. 44	389	43, 134	エネルギー
ECOLAB INC		64	930	102, 994	素材
EQUIFAX INC		29	363	40, 230	資本財・サービス
GAP INC/THE		59. 5	186	20, 632	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC		316	2, 248	248, 846	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC		43. 48	524	58, 051	生活必需品
HORMEL FOODS CORP		73. 5	265	29, 375	生活必需品
STATE STREET CORP		89. 43	878	97, 258	金融
SUNTRUST BANKS INC		115. 48	795	88, 050	金融

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
SCHWAB (CHARLES) CORP		295	1,669	184,835	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC		127	957	105,999	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO		44	160	17,780	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC		31	139	15,429	素材
CARDINAL HEALTH INC		78	426	47,153	ヘルスケア
FEDEX CORP		62	1,633	180,804	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		118.54	1,141	126,319	金融
FMC CORP		33.5	302	33,481	素材
FLEX LTD		129	180	20,003	情報技術
CERNER CORP		73	445	49,350	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		19	236	26,183	素材
CITRIX SYSTEMS INC		37	395	43,744	情報技術
INTEL CORP		1,140	6,331	700,777	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC		94	221	24,532	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		86	456	50,524	金融
ILLINOIS TOOL WORKS		74.5	1,109	122,769	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC		385	284	31,447	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC		35.5	1,030	114,007	ヘルスケア
SEALED AIR CORP		44	193	21,461	素材
INTUITIVE SURGICAL INC		27.1	1,342	148,627	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH		31.5	314	34,843	情報技術
SNAP-ON INC		14	223	24,711	資本財・サービス
CARMAX INC		46	336	37,278	一般消費財・サービス
COMERICA INC		42	399	44,244	金融
INGREDION INC		17	192	21,286	生活必需品
DUKE ENERGY CORP		172.78	1,269	140,479	公益事業
TARGET CORP		125	965	106,833	一般消費財・サービス
DOVER CORP		39	296	32,831	資本財・サービス
WW GRAINGER INC		13	412	45,667	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		31	202	22,422	資本財・サービス
CINTAS CORP		22	421	46,644	資本財・サービス
CA INC		75.05	278	30,784	情報技術
CONAGRA BRANDS INC		100	382	42,279	生活必需品
CLOROX COMPANY		31	396	43,880	生活必需品
ENTERGY CORP		44	337	37,357	公益事業
MICROSOFT CORP		1,783	18,083	2,001,447	情報技術
INCYTE CORP		43	316	35,047	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP		246.74	1,705	188,761	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC		330.88	2,864	317,034	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC		282	1,668	184,711	情報技術
BLACKROCK INC		29.4	1,538	170,300	金融
CENTERPOINT ENERGY INC		103	269	29,845	公益事業
HASBRO INC		28.5	261	28,897	一般消費財・サービス
KELLOGG CO		64.5	429	47,544	生活必需品
KEYCORP		267	548	60,669	金融
KANSAS CITY SOUTHERN		25.5	277	30,667	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A		366.11	1,479	163,705	生活必需品
KOHL'S CORP		41.5	304	33,659	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE		12	282	31,231	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP		120	138	15,326	金融
APACHE CORP		92.6	397	43,957	エネルギー
CHUBB LTD		113.49	1,476	163,419	金融
ARROW ELECTRONICS INC		21.5	170	18,822	情報技術
ALLSTATE CORP		89	825	91,412	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2018年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
EBAY INC		239	932	103,164	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC		278	2,379	263,413	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO		34.5	372	41,212	素材
XILINX INC		61.5	433	47,940	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO		138.6	1,139	126,158	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP-A		57.5	195	21,688	一般消費財・サービス
ZIONS BANCORPORATION		48	266	29,458	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		55	860	95,188	生活必需品
TOLL BROTHERS INC		38	148	16,423	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC		64	226	25,075	情報技術
LENNAR CORP-A		71	376	41,703	一般消費財・サービス
LEAR CORP		16.5	334	37,015	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP		65	421	46,647	金融
PROGRESSIVE CORP		143	885	97,954	金融
PRAXAIR INC		70	1,130	125,162	素材
PACCAR INC		86.87	553	61,303	資本財・サービス
PVH CORP		18.5	296	32,810	一般消費財・サービス
BIOGEN INC		51.6	1,577	174,576	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC		21	474	52,547	ヘルスケア
STARBUCKS CORP		346	1,972	218,359	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC		30.5	228	25,260	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY		77.3	417	46,191	公益事業
INTUIT INC		59.5	1,244	137,688	情報技術
BORGWARNER INC		51	248	27,557	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC		65	476	52,747	一般消費財・サービス
BALL CORP		80.34	296	32,793	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP		332.47	1,080	119,629	ヘルスケア
XL GROUP LTD		61	342	37,943	金融
ELECTRONIC ARTS INC		75.5	1,090	120,657	情報技術
VULCAN MATERIALS CO		32	421	46,701	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		62	960	106,356	ヘルスケア
VF CORP		83.5	701	77,658	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING		83.71	461	51,068	一般消費財・サービス
VIACOM INC-CLASS B		86.71	250	27,745	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC		15.7	336	37,205	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		22	271	30,025	ヘルスケア
CARNIVAL CORP		106.5	683	75,675	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A		1,137.9	3,848	425,938	一般消費財・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		52	192	21,294	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		53	332	36,803	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD		90	79	8,815	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		285	210	23,342	不動産
アメリカ・ドル通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	75,001.08 599銘柄	596,423	66,012,121 <63.7%>
		百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)					
IMPERIAL OIL LTD		71	306	25,841	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		5	524	44,272	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		50.96	133	11,276	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN		55.87	440	37,122	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		107	312	26,311	素材
INTACT FINANCIAL CORP		35.5	337	28,470	金融
BCE INC		37.3	202	17,083	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP		47	429	36,182	素材

銘	柄	2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千カナダ・ドル	千円	
SUNCOR ENERGY INC		411.3	2,144	180,847	エネルギー
METRO INC		55	241	20,380	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA		85	542	45,710	金融
BANK OF NOVA SCOTIA		298	2,264	190,940	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		107.5	1,238	104,434	金融
TORONTO-DOMINION BANK		456	3,474	293,023	金融
GREAT-WEST LIFECO INC		76	253	21,374	金融
ROYAL BANK OF CANADA		359.5	3,589	302,711	金融
TOURMALINE OIL CORP		54	130	10,983	エネルギー
VERMILION ENERGY INC		28	128	10,826	エネルギー
TRANSCANADA CORP		216.5	1,180	99,557	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		127.29	575	48,573	エネルギー
BOMBARDIER INC-B		530	259	21,855	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP		286	493	41,604	素材
CAE INC		65	178	15,068	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP		71.04	381	32,188	金融
EMPIRE CO LTD 'A'		46	112	9,527	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD		16	137	11,621	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B		34.5	227	19,207	素材
LINAMAR CORP		13	82	6,986	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A		64	94	7,993	エネルギー
HYDRO ONE LTD		72	140	11,846	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD		54.6	359	30,287	生活必需品
WSP GLOBAL INC		27	199	16,810	資本財・サービス
EMERA INC		13	52	4,410	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A		33	103	8,746	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		90	557	47,010	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD		59	359	30,330	素材
KINROSS GOLD CORP		295	146	12,364	素材
BANK OF MONTREAL		163	1,659	139,987	金融
POWER CORP OF CANADA		86	263	22,214	金融
METHANEX CORP		22	197	16,617	素材
SHOPIFY INC - CLASS A		22	484	40,854	情報技術
NUTRIEN LTD		159.19	1,119	94,387	素材
CAMECO CORP		92	145	12,297	エネルギー
TELUS CORP		54	249	21,052	電気通信サービス
POWER FINANCIAL CORP		62	200	16,867	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B		140	524	44,190	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		16	276	23,353	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		248	93	7,842	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES		308	1,293	109,063	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		7	532	44,871	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC		87	745	62,904	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD		13	135	11,392	生活必需品
BLACKBERRY LTD		119	190	16,056	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC		152.5	834	70,371	金融
ENBRIDGE INC		428	1,827	154,082	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		208.5	1,147	96,758	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP		494	1,228	103,605	金融
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE		87	305	25,729	ヘルスケア
GOLDCORP INC		218.59	409	34,544	素材
ENCANA CORP		243	403	34,017	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		36	915	77,238	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2018年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千カナダ・ドル	千円	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC		25	131	11,068	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC		56	211	17,874	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO		185.5	2,029	171,183	資本財・サービス
CGI GROUP INC - CLASS A		65	529	44,619	情報技術
HUSKY ENERGY INC		84.58	167	14,101	エネルギー
ONEX CORPORATION		20	185	15,639	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		107	295	24,958	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC		44	149	12,593	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC		45	268	22,621	資本財・サービス
IGM FINANCIAL INC		19	75	6,370	金融
OPEN TEXT CORP		66	310	26,214	情報技術
CI FINANCIAL CORP		70	174	14,734	金融
SAPUTO INC		58	252	21,291	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		177	388	32,763	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		110	602	50,824	生活必需品
FORTIS INC		104	422	35,607	公益事業
LUNDIN MINING CORP		161	134	11,336	素材
CRESCENT POINT ENERGY CORP		133	130	10,969	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC		272	336	28,396	エネルギー
DOLLARAMA INC		26	394	33,263	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I		17	66	5,622	公益事業
ALTAGAS LTD		45	117	9,923	エネルギー
FIRST CAPITAL REALTY INC		38	80	6,755	不動産
KEYERA CORP		48	173	14,604	エネルギー
INTER PIPELINE LTD		95	233	19,675	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		83	109	9,246	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	10,072.72 87銘柄	45,492	3,836,346 <3.7%>	
(オーストラリア)		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD		455	104	8,599	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD		665	192	15,915	金融
BHP BILLITON LIMITED		796.5	2,658	219,423	素材
SOUTH32 LTD		1,286	489	40,436	素材
ALUMINA LTD		623	170	14,088	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		235	792	65,398	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		388	180	14,890	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		118	120	9,904	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		687.5	1,784	147,238	金融
WESTPAC BANKING CORP		840.48	2,294	189,365	金融
SANTOS LTD		452	263	21,710	エネルギー
AUSNET SERVICES		410	63	5,261	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP		736	1,928	159,144	金融
RIO TINTO LTD		104.5	884	72,979	素材
ORIGIN ENERGY LTD		437	423	34,983	エネルギー
AMCOR LIMITED		281	387	31,980	素材
AURIZON HOLDINGS LTD		495	213	17,648	資本財・サービス
OIL SEARCH LTD		329	275	22,753	エネルギー
SEEK LTD		83	175	14,501	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		180	315	26,071	生活必需品
NEWCREST MINING LTD		186.5	382	31,553	素材
INCITEC PIVOT LTD		423	145	12,044	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		433.5	2,923	241,314	金融

銘柄		2018年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
CALTEX AUSTRALIA LTD		64.5	195	16,139	エネルギー
ORICA LTD		92	159	13,203	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		343	318	26,326	金融
CIMIC GROUP LTD		24	97	8,013	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD		330	956	78,926	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD		137	121	10,028	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD		484	222	18,334	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD		96	127	10,497	一般消費財・サービス
TELSTRA CORP LTD		1,046	303	25,034	電気通信サービス
AMP LTD		750	272	22,468	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		111	240	19,833	素材
MACQUARIE GROUP LTD		79.84	905	74,754	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		145.5	430	35,544	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD		91	90	7,442	金融
CSL LTD		113.5	2,120	174,969	ヘルスケア
WESFARMERS LTD		278.95	1,311	108,202	生活必需品
COCHLEAR LTD		14	265	21,929	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD		134	245	20,293	素材
SUNCORP GROUP LTD		327	453	37,431	金融
BORAL LTD		277	175	14,493	素材
ASX LTD		47	291	24,029	金融
COMPUTERSHARE LTD		114	203	16,812	情報技術
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		140	49	4,043	一般消費財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		610	484	39,972	金融
SONIC HEALTHCARE LTD		104	248	20,513	ヘルスケア
CHALLENGER LTD		139	171	14,190	金融
AGL ENERGY LTD		164	351	29,018	公益事業
BRAMBLES LTD		395	356	29,437	資本財・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L		14	87	7,228	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD		35.5	205	16,928	ヘルスケア
TPG TELECOM LTD		87	47	3,927	電気通信サービス
REA GROUP LTD		12	108	8,924	情報技術
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		14	72	5,942	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	17,458.77 56銘柄	28,862 2,382,046	<2.3%>
(香港)		百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		350	1,935	27,290	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		590	3,826	53,948	一般消費財・サービス
MTR CORP		380	1,656	23,360	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES		400	4,928	69,484	不動産
SINO LAND CO		740	988	13,939	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		661.69	5,842	82,382	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD		320	816	11,505	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		125	1,037	14,628	不動産
CLP HOLDINGS LTD		415	3,371	47,543	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		329.16	1,449	20,444	不動産
HANG LUNG GROUP LTD		210	496	7,002	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		2,301.81	3,420	48,228	公益事業
HANG SENG BANK LTD		196	3,878	54,691	金融
WHEELOCK & CO LTD		200	1,153	16,257	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT		1,490	1,767	24,916	不動産
WH GROUP LTD		2,225	1,548	21,835	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		294	7,514	105,956	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2018年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千香港ドル	千円	
MINTH GROUP LTD		180	668	9,428	一般消費財・サービス
LI & FUNG LTD		1,520	457	6,451	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD		500	865	12,196	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		76	804	11,348	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		190	441	6,228	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD		355	517	7,298	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD		175	749	10,573	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		326.4	1,044	14,727	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO		170	760	10,726	不動産
SJM HOLDINGS LTD		470	485	6,852	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		288	888	12,527	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		636.69	4,179	58,936	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		160	945	13,332	公益事業
PCCW LTD		950	426	6,014	電気通信サービス
AIA GROUP LTD		3,046	21,367	301,284	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		300	1,783	25,147	不動産
SANDS CHINA LTD		604	2,733	38,536	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD		300	500	7,055	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		330	1,559	21,985	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD		236	499	7,037	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		920	3,661	51,628	金融
WYNN MACAU LTD		380	1,075	15,163	一般消費財・サービス
香港ドル通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	23,340.75 39銘柄	92,049 <1.3%>	
(シンガポール)		百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD		331	892	73,326	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD		442	1,220	100,313	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD		136.7	152	12,573	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD		363	262	21,603	資本財・サービス
UOL GROUP LTD		140	107	8,826	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		104	116	9,583	不動産
CAPITALAND LTD		630	213	17,555	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING		568	54	4,505	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		410	107	8,863	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		27	89	7,357	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		790	958	78,769	金融
GENTING SINGAPORE LTD		1,530	186	15,343	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD		72	144	11,901	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		2,038.5	650	53,453	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING		395	136	11,201	資本財・サービス
SEBMCORP INDUSTRIES LTD		227	63	5,224	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		1,644	52	4,324	生活必需品
SATS LTD		160	80	6,602	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD		208	149	12,327	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD		553	128	10,545	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD		432	141	11,647	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	11,201.2 21銘柄	5,910 <0.5%>	
(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	81	6,300	公益事業
A2 MILK CO LTD		190	218	16,809	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD		526.89	200	15,402	電気通信サービス

銘 柄		2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		234	162	12,475	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		201	135	10,437	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		135	202	15,588	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD		88	105	8,123	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,634.89 7 銘柄	1,106	85,137 <0.1%>	
(イギリス)		百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT		163	62	9,151	一般消費財・サービス
TUI AG-DI		109.47	193	28,328	一般消費財・サービス
BP PLC		4,884	2,859	419,386	エネルギー
UNILEVER PLC		306.6	1,236	181,370	生活必需品
BARCLAYS PLC		4,230	848	124,446	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		417	368	53,989	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC		421	129	18,955	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD		22.8	135	19,875	素材
PRUDENTIAL PLC		640	1,193	175,006	金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP		873.91	230	33,784	金融
JOHNSON MATTHEY PLC		49.64	189	27,832	素材
BAE SYSTEMS PLC		787	512	75,116	資本財・サービス
AVIVA PLC		985.66	509	74,735	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC		1,221.52	1,930	283,089	ヘルスケア
INFORMA PLC		320	267	39,168	一般消費財・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL		105	143	21,058	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC		1,195	287	42,149	資本財・サービス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC		93	52	7,695	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC		224	94	13,866	情報技術
DCC PLC		21.5	155	22,860	資本財・サービス
GVC HOLDINGS PLC		140	144	21,251	一般消費財・サービス
CONVATEC GROUP PLC		330	75	11,029	ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC		223	112	16,522	資本財・サービス
NMC HEALTH PLC		27	99	14,587	ヘルスケア
RELX PLC		267.46	430	63,133	資本財・サービス
DIAGEO PLC		618	1,714	251,378	生活必需品
RIO TINTO PLC		300.5	1,322	194,001	素材
STANDARD CHARTERED PLC		813	594	87,148	金融
TESCO PLC		2,458	614	90,050	生活必需品
FRESNILLO PLC		56	67	9,904	素材
SMITH & NEPHEW PLC		221	301	44,161	ヘルスケア
GLENCORE PLC		3,066.25	1,221	179,203	素材
WOOD GROUP (JOHN) PLC		162	104	15,253	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC		68	141	20,823	金融
SMITHS GROUP PLC		102.33	184	27,028	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC		61	52	7,661	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		334.83	119	17,521	金融
PEARSON PLC		201.63	178	26,117	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC		410.25	129	18,934	生活必需品
NEXT PLC		35.5	219	32,248	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC		842	158	23,228	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC		46.11	192	28,206	一般消費財・サービス
BUNZL PLC		82.55	193	28,450	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC		6,676.83	1,255	184,152	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		31.93	158	23,231	素材
KINGFISHER PLC		554.11	174	25,558	一般消費財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
WPP PLC		313	384	56,462	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC		171.27	134	19,748	公益事業
SEVERN TRENT PLC		57.33	107	15,807	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		167.5	1,030	151,078	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC		136	168	24,742	金融
SCHRODERS PLC		30.5	99	14,653	金融
SSE PLC		251	341	50,063	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE		61.5	127	18,670	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		259	145	21,347	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC		314.5	1,713	251,286	ヘルスケア
FERGUSON PLC		58.87	360	52,908	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		1,465	400	58,698	金融
3I GROUP PLC		238.91	234	34,323	金融
SKY PLC		255	344	50,487	一般消費財・サービス
ASHTED GROUP PLC		127	302	44,403	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE		276.14	187	27,555	情報技術
NATIONAL GRID PLC		842.34	702	103,067	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC		17,859.65	1,127	165,356	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC		262.6	172	25,341	金融
IMPERIAL BRANDS PLC		234.5	611	89,693	生活必需品
CENTRICA PLC		1,436.6	220	32,288	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		32	134	19,706	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		567.1	2,117	310,601	生活必需品
BHP BILLITON PLC		519.77	908	133,310	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		91	250	36,715	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		4,977	3,656	536,204	金融
SHIRE PLC		225.74	918	134,729	ヘルスケア
OLD MUTUAL PLC		1,225.25	278	40,772	金融
ANGLO AMERICAN PLC		328.83	589	86,488	素材
MONDI PLC		93.5	195	28,618	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS		549	135	19,823	生活必需品
CARNIVAL PLC		45.11	215	31,583	一般消費財・サービス
EASYJET PLC		40	71	10,536	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC		394.39	636	93,413	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC		79	215	31,595	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC		2,134	456	67,007	電気通信サービス
COCA-COLA HBC AG-DI		44	115	16,971	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC		104.89	226	33,273	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		46.36	229	33,615	一般消費財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC		59	84	12,386	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC		40.5	236	34,628	資本財・サービス
ITV PLC		931	162	23,846	一般消費財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		78.99	354	52,015	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		1,126	2,936	430,600	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		933.18	2,529	370,959	エネルギー
MEGGITT PLC		195	97	14,345	資本財・サービス
G4S PLC		378	105	15,494	資本財・サービス
ADMIRAL GROUP PLC		49.5	94	13,851	金融
INVESTEC PLC		160	91	13,398	金融
ANTOFAGASTA PLC		98	104	15,306	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		671.57	237	34,787	金融
EXPERIAN PLC		226.54	426	62,528	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株 数、金 額	76,461.81	49,091	7,199,763	
	銘 柄 数 < 比 率 >	98 銘柄		<7.0%>	

銘 柄		2018年 6 月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イスラエル)		百株	千イスラエル・シェケル	千円	
AZRIELI GROUP LTD		10	184	5,646	不動産
FRUTAROM		9	316	9,705	素材
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		483	193	5,915	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD		176	313	9,592	素材
ELBIT SYSTEMS LTD		6	266	8,164	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM		266	663	20,313	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL		354	786	24,074	金融
NICE LTD		14	555	17,018	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		30	201	6,159	金融
イスラエル・シェケル通貨計		株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,348 9 銘柄	3,481 <0.1%>	
(スイス)		百株	千スイス・フラン	千円	
DUFREY AG-REG		8.5	118	13,166	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG		977	1,539	170,789	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		2	131	14,574	素材
ADECCO GROUP AG-REG		39	237	26,318	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		177	3,740	414,841	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR		9.5	85	9,515	金融
SIKA AG-REG		31.8	465	51,603	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.03	226	25,156	生活必需品
ABB LTD-REG		459	1,072	118,981	資本財・サービス
SWISS RE AG		77.5	690	76,541	金融
NESTLE SA-REG		770.5	5,749	637,731	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG		4.2	312	34,613	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		9.7	215	23,885	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		651.2	1,018	113,005	金融
JULIUS BAER GROUP LTD		55.5	340	37,724	金融
SGS SA-REG		1.3	346	38,428	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		5	108	12,079	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG		12	195	21,675	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG		15.5	239	26,528	情報技術
SWATCH GROUP AG/THE-BR		7.9	393	43,646	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		38.02	1,142	126,684	金融
BALOISE HOLDING AG - REG		12	179	19,925	金融
CLARIANT AG-REG		57	141	15,673	素材
NOVARTIS AG-REG		553.5	4,178	463,526	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.6	108	12,072	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG		131	1,212	134,465	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG		6.6	294	32,650	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG		9.1	402	44,594	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG		2.3	519	57,656	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG		2.7	207	23,015	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG		13	226	25,090	ヘルスケア
LONZA GROUP AG-REG		18.3	503	55,820	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG		13	117	13,049	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		113.9	594	65,973	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		8.2	289	32,061	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		13.5	207	23,007	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG		18.5	171	18,970	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.25	158	17,580	生活必需品
スイス・フラン通貨計		株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4,325.6 38 銘柄	27,881 <3.0%>	

外国株式インデックスマザーファンド

銘		柄	2018年6月15日現在			業 種 等
			株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(デンマーク)			百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B			464	13,265	227,773	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S			188	4,119	70,724	金融
ISS A/S			39	867	14,892	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A			0.95	881	15,128	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S			17	780	13,409	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S			52.5	2,174	37,337	資本財・サービス
CARLSBERG AS-B			26	1,922	33,017	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES			58	1,902	32,674	素材
COLOPLAST-B			29.5	1,883	32,346	ヘルスケア
DSV A/S			47.5	2,575	44,220	資本財・サービス
WILLIAM DEMANT HOLDING			26.75	691	11,868	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B			1.6	1,589	27,285	資本財・サービス
TRYG A/S			25	376	6,464	金融
PANDORA A/S			27.5	1,343	23,070	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S			25.5	1,663	28,555	素材
GENMAB A/S			14	1,382	23,744	ヘルスケア
ORSTED A/S			47	1,762	30,254	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計		株 数、金 額	1,089.8	39,182	672,766	
		銘 柄 数 < 比 率 >	17 銘柄		<0.6%>	
(ノルウェー)			百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA			352	1,869	25,420	素材
DNB ASA			239.5	3,798	51,659	金融
ORKLA ASA			208.5	1,525	20,745	生活必需品
TELENOR ASA			186	3,175	43,180	電気通信サービス
EQUINOR ASA			284.23	6,218	84,577	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA			41.6	1,440	19,592	素材
MARINE HARVEST			99	1,695	23,063	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA			48.5	627	8,535	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS			24	589	8,013	一般消費財・サービス
AKER BP ASA			29	883	12,013	エネルギー
ノルウェー・クローネ通貨計		株 数、金 額	1,512.33	21,823	296,800	
		銘 柄 数 < 比 率 >	10 銘柄		<0.3%>	
(スウェーデン)			百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB			19	520	6,580	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS			781.3	5,326	67,332	情報技術
VOLVO AB-B SHS			391	5,859	74,059	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR			15	825	10,428	電気通信サービス
SKF AB-B SHARES			97.5	1,679	21,234	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B			59.5	1,300	16,432	一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB			748	6,404	80,951	金融
SWEDISH MATCH AB			46	1,951	24,670	生活必需品
TELE2 AB-B SHS			89.5	1,038	13,128	電気通信サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A			386.5	3,210	40,577	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS			374.5	3,703	46,806	金融
SWEDBANK AB - A SHARES			224	4,251	53,739	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS			235.5	3,298	41,691	一般消費財・サービス
SKANSKA AB-B SHS			83.5	1,338	16,913	資本財・サービス
SANDVIK AB			284.5	4,455	56,314	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS			113.5	4,241	53,612	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS			165.5	4,616	58,354	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS			74	1,075	13,600	資本財・サービス

銘柄		2018年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
TELIA CO AB		716	3,074	38,861	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB		70	1,571	19,863	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		97	2,459	31,093	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		249	4,757	60,130	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS		18	514	6,497	金融
LUNDIN PETROLEUM AB		46.5	1,319	16,680	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B		150	3,231	40,839	生活必需品
BOLIDEN AB		65	1,986	25,103	素材
EPIROC AB-A		165.5	1,387	17,540	その他
EPIROC AB-B		97	781	9,876	その他
HUSQVARNA AB-B SHS		97.5	857	10,842	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B		56.5	1,791	22,646	金融
HEXAGON AB-B SHS		65	3,346	42,295	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		40	739	9,343	金融
スウェーデン・クローネ通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,121.3 32銘柄	82,914 <1.0%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (アイルランド)					
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		60	208	26,644	素材
AIB GROUP PLC		200	99	12,687	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC		236.6	166	21,334	金融
KERRY GROUP PLC-A		39.7	354	45,368	生活必需品
CRH PLC		208.5	680	86,988	素材
PADDY POWER BETFAIR PLC		20.5	200	25,695	一般消費財・サービス
国小計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	765.3 6銘柄	1,710 <0.2%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オランダ)					
QIAGEN N. V.		55.98	180	23,061	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		237.26	876	112,141	ヘルスケア
NN GROUP NV		76	280	35,858	金融
UNILEVER NV-CVA		403	1,880	240,502	生活必需品
HEINEKEN NV		63.5	558	71,486	生活必需品
RELX NV		237.19	433	55,409	資本財・サービス
AEGON NV		447.44	242	31,074	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		319.83	653	83,591	生活必需品
AKZO NOBEL		63	481	61,528	素材
KONINKLIJKE DSM NV		45.5	410	52,479	素材
WOLTERS KLUWER		73	351	44,965	資本財・サービス
ING GROEP NV		972.5	1,237	158,239	金融
KONINKLIJKE KPN NV		842.5	203	25,979	電気通信サービス
ASML HOLDING NV		98.5	1,828	233,821	情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA		103	237	30,325	金融
VOPAK		19	79	10,133	エネルギー
RANDSTAD NV		28.5	152	19,486	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		28.5	242	30,983	生活必需品
AIRBUS SE		144.5	1,510	193,243	資本財・サービス
EXOR NV		26.8	165	21,190	金融
CNH INDUSTRIAL NV		252	255	32,633	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		266.5	486	62,164	一般消費財・サービス
FERRARI NV		31.45	400	51,165	一般消費財・サービス
国小計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,835.45 23銘柄	13,146 <1.6%>	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2018年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ベルギー)					
UCB SA		32. 5	215	27, 600	ヘルスケア
KBC GROUP NV		62	415	53, 082	金融
COLRUYT SA		16	73	9, 405	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		20	187	24, 019	金融
SOLVAY SA		18	204	26, 106	素材
UMICORE		51	260	33, 266	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		190	1, 596	204, 201	生活必需品
AGEAS		45. 4	200	25, 648	金融
PROXIMUS		35	76	9, 745	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		12	49	6, 360	一般消費財・サービス
国	小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	481. 9 10 銘柄	3, 279 <0. 4% >	
ユーロ (ルクセンブルグ)		百株	千ユーロ	千円	
RTL GROUP		10	65	8, 383	一般消費財・サービス
ARCELOMITTAL		169	490	62, 781	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		2. 7	113	14, 469	ヘルスケア
SES		90	140	17, 962	一般消費財・サービス
TENARIS SA		112. 5	177	22, 691	エネルギー
国	小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	384. 2 5 銘柄	987 <0. 1% >	
ユーロ (フランス)		百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA		19	53	6, 789	一般消費財・サービス
TOTAL SA		604. 5	3, 195	408, 689	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		42. 5	469	60, 065	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		107. 02	1, 199	153, 440	素材
KERING		18. 8	967	123, 736	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		141	1, 067	136, 516	資本財・サービス
BOUYGUES SA		52. 5	204	26, 100	資本財・サービス
BNP PARIBAS		278	1, 524	194, 990	金融
PEUGEOT SA		145	309	39, 539	一般消費財・サービス
NATIXIS		229. 5	146	18, 756	金融
THALES SA		26. 8	296	37, 944	資本財・サービス
DANONE		151. 5	984	125, 930	生活必需品
CARREFOUR SA		149	231	29, 595	生活必需品
SUEZ		88. 75	102	13, 110	公益事業
VIVENDI		254. 41	557	71, 260	一般消費財・サービス
L'OREAL		63	1, 329	170, 098	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		125	518	66, 356	資本財・サービス
LEGRAND SA		65. 67	426	54, 561	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		13	44	5, 703	生活必需品
PERNOD RICARD SA		54. 17	784	100, 391	生活必需品
SOCIETE BIC SA		7	55	7, 153	資本財・サービス
EURAZEO SA		10. 45	70	8, 974	金融
REXEL SA		70. 5	94	12, 046	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA		193. 5	724	92, 708	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		69	2, 087	267, 003	一般消費財・サービス
ACCOR SA		46. 5	207	26, 560	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		39. 9	470	60, 217	情報技術
VALEO SA		59. 5	317	40, 592	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		52. 5	311	39, 872	一般消費財・サービス
BUREAU VERITAS SA		65	151	19, 436	資本財・サービス

銘柄		2018年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
EIFFAGE		18.2	175	22,430	資本財・サービス
SODEXO SA		23	197	25,216	一般消費財・サービス
IPSEN		9	123	15,781	ヘルスケア
INGENICO GROUP		16	122	15,650	情報技術
AMUNDI SA		15	94	12,144	金融
TELEPERFORMANCE		14	195	25,032	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		20	199	25,513	情報技術
FAURECIA		19	136	17,501	一般消費財・サービス
SEB SA		5.6	85	10,936	一般消費財・サービス
ESSILOR INTERNATIONAL		52	629	80,574	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA		0.6	102	13,076	資本財・サービス
AXA SA		482	1,052	134,607	金融
EDENRED		59.5	163	20,874	資本財・サービス
RENAULT SA		47	398	50,993	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		7.8	430	55,008	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		5.5	69	8,898	生活必需品
ATOS SE		23.5	289	37,044	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA		32	396	50,730	情報技術
WENDEL		6.8	85	10,906	金融
ORANGE		502.5	735	94,090	電気通信サービス
ALSTOM		40.5	163	20,854	資本財・サービス
CNP ASSURANCES		43	85	10,872	金融
SANOFI		281.75	1,897	242,629	ヘルスケア
VINCI SA		127	1,089	139,367	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		136.5	266	34,061	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		281	338	43,307	金融
BIOMERIEUX		10	81	10,475	ヘルスケア
ENGIE		461.73	641	82,057	公益事業
IMERYS SA		9	64	8,218	素材
EDF		139.5	161	20,607	公益事業
SAFRAN SA		83	864	110,562	資本財・サービス
ILIAD SA		6.5	92	11,801	電気通信サービス
ARKEMA		16.5	171	21,926	素材
ADP		7.4	144	18,418	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		40.5	71	9,168	一般消費財・サービス
SCOR SE		41.5	134	17,154	金融
GETLINK		112.5	137	17,539	資本財・サービス
BOLLORE		213	88	11,354	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,652.85 68銘柄	31,083	3,975,536 <3.8%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ドイツ）					
BAYER AG-REG		205	2,066	264,292	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		42.5	131	16,839	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		506.5	489	62,559	金融
COMMERZBANK AG		263.35	244	31,314	金融
VOLKSWAGEN AG		8	130	16,678	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		46.2	754	96,517	一般消費財・サービス
MAN SE		8.5	79	10,126	資本財・サービス
SIEMENS AG-REG		189	2,281	291,769	資本財・サービス
E.ON SE		545	505	64,630	公益事業
UNIPER SE		49	125	16,031	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		82.5	711	91,029	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		45	144	18,434	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG		25.6	132	16,993	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2018年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
CONTINENTAL AG		27	595	76,145	一般消費財・サービス
BASF SE		227.5	2,003	256,259	素材
K+S AG-REG		48	110	14,071	素材
ALLIANZ SE-REG		110.1	2,015	257,781	金融
THYSSENKRUPP AG		107	253	32,420	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		44.5	489	62,663	生活必需品
RWE AG		131.5	263	33,738	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		56.5	134	17,227	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		10	85	10,871	資本財・サービス
BRENNTAG AG		39.5	199	25,482	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		105	744	95,268	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		30	174	22,285	情報技術
HOCHTIEF AG		4.5	72	9,220	資本財・サービス
SAP SE		243.42	2,538	324,721	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		38.3	710	90,917	金融
SCHAEFFLER AG		38	49	6,320	一般消費財・サービス
ZALANDO SE		29	138	17,662	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		37	287	36,779	素材
KION GROUP AG		18.5	134	17,159	資本財・サービス
WIRECARD AG		29.5	461	58,972	情報技術
COVESTRO AG		49	380	48,632	素材
INNOGY SE		34	125	16,002	公益事業
SARTORIUS AG-VORZUG		9.5	126	16,160	ヘルスケア
PORSCHЕ AUTOMOBIL HLDG-PRF		37.5	236	30,273	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO AG		25	102	13,109	情報技術
METRO AG		41	46	5,978	生活必需品
1&1 DRILLISCH AG		13	83	10,716	電気通信サービス
LINDE AG - TENDER		46.3	968	123,883	素材
SIEMENS HEALTHINEERS AG		40	143	18,358	ヘルスケア
BEIERSDORF AG		25.5	253	32,405	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF		17	78	10,088	素材
MERCK KGAA		32.5	273	34,974	ヘルスケア
ADIDAS AG		46.6	926	118,457	一般消費財・サービス
PUMA SE		1.56	78	10,075	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		26.5	260	33,334	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		831	1,150	147,204	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		53	468	59,977	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		238.5	1,507	192,755	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		287.5	732	93,729	情報技術
HANNOVER RUECK SE		15	167	21,468	金融
DEUTSCHE POST AG-REG		244.5	742	94,940	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		49	570	72,949	金融
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE		59.5	144	18,454	一般消費財・サービス
LANXESS AG		22	158	20,332	素材
MTU AERO ENGINES AG		13.3	221	28,339	資本財・サービス
AXEL SPRINGER SE		12	73	9,454	一般消費財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE		88.5	365	46,714	不動産
SYMRISE AG		30	225	28,831	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		188	69	8,829	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		13.5	100	12,854	一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD		15.9	127	16,272	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		121	502	64,224	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,118.13 65銘柄	30,672	3,922,975 <3.8%>	

銘柄		2018年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ (ポルトガル)		百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS		60	80	10,260	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		565	192	24,569	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		116.5	188	24,108	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	741.5 3銘柄	460	58,938 <0.1%>	
ユーロ (スペイン)		百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA		1,149.27	867	110,963	電気通信サービス
ENDESA SA		76.5	149	19,084	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		1,664.12	1,014	129,705	金融
IBERDROLA SA		1,462.34	973	124,564	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		1,309.09	192	24,595	金融
BANKINTER SA		166	144	18,424	金融
REPSOL SA		338.5	582	74,552	エネルギー
GRIFOLS SA		72	198	25,425	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		4,057.5	1,942	248,397	金融
AMADEUS IT GROUP SA		110	794	101,634	情報技術
GAS NATURAL SDG SA		84.5	184	23,549	公益事業
MAPFRE SA		254.5	65	8,407	金融
CAIXABANK S. A		888	342	43,805	金融
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		152	124	15,922	資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		61.76	227	29,068	資本財・サービス
AENA SME SA		17	272	34,799	資本財・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		274.5	824	105,430	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		56	73	9,418	資本財・サービス
ENAGAS SA		54	132	16,934	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA		107	191	24,489	公益事業
FERROVIAL SA		123	226	28,993	資本財・サービス
BANKIA SA		301.05	101	13,045	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,778.63 22銘柄	9,626	1,231,215 <1.2%>	
ユーロ (イタリア)		百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA		53.5	137	17,585	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		313.43	461	59,069	金融
MEDIOBANCA SPA		152.65	124	15,943	金融
UNICREDIT SPA		492.56	715	91,473	金融
TELECOM ITALIA SPA		2,827.82	193	24,738	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP		1,469.5	88	11,273	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO-RSP		210	56	7,225	金融
INTESA SANPAOLO		3,360.97	871	111,507	金融
ATLANTIA SPA		114.07	287	36,707	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		135	105	13,502	金融
MONCLER SPA		47	198	25,355	一般消費財・サービス
RECORDATI SPA		26	86	11,073	ヘルスケア
ENI SPA		638	1,008	129,042	エネルギー
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		143	99	12,665	生活必需品
PIRELLI & C SPA		110	81	10,411	一般消費財・サービス
LEONARDO SPA		95.25	85	10,961	資本財・サービス
ENEL SPA		2,019.34	984	125,856	公益事業
SNAM SPA		566	204	26,155	エネルギー

外国株式インデックスマザーファンド

銘		柄	2018年6月15日現在			業 種 等	
			株 数	評 価 額			
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
LUXOTTICA GROUP SPA			百株	千ユーロ	千円	一般消費財・サービス 公益事業	
TERNA SPA			41	227	29,135		
			349	162	20,783		
国 小 計			株 数、金 額	13,164.09	6,180	790,466	
			銘 柄 数 < 比 率 >	20 銘柄		<0.8%>	
ユーロ（フィンランド）			百株	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ			130	414	52,956	素材	
NOKIA OYJ			1,467.5	768	98,313	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP			108	189	24,249	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS			138	244	31,320	素材	
METSO OYJ			28	86	11,101	資本財・サービス	
ELISA OYJ			36.5	143	18,327	電気通信サービス	
SAMPO OYJ-A SHS			111	469	59,996	金融	
FORTUM OYJ			111.5	226	28,949	公益事業	
KONE OYJ-B			82	365	46,744	資本財・サービス	
NOKIAN RENKAAT OYJ			30.5	106	13,567	一般消費財・サービス	
NESTE OYJ			31.5	211	26,993	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B			24.5	59	7,652	ヘルスケア	
国 小 計			株 数、金 額	2,299	3,285	420,172	
			銘 柄 数 < 比 率 >	12 銘柄		<0.4%>	
ユーロ（オーストリア）			百株	千ユーロ	千円		
OMV AG			35.5	179	22,965	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG			74	268	34,347	金融	
VOESTALPINE AG			28.5	127	16,308	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA			34	95	12,176	金融	
ANDRITZ AG			16	70	8,991	資本財・サービス	
国 小 計			株 数、金 額	188	741	94,788	
			銘 柄 数 < 比 率 >	5 銘柄		<0.1%>	
ユーロ（その他）			百株	千ユーロ	千円		
STMICROELECTRONICS NV			173.5	392	50,239	情報技術	
国 小 計			株 数、金 額	173.5	392	50,239	
			銘 柄 数 < 比 率 >	1 銘柄		<0.0%>	
ユ ー ロ 通 貨 計			株 数、金 額	48,582.55	101,565	12,990,246	
			銘 柄 数 < 比 率 >	240 銘柄		<12.5%>	
フ ァ ン ド 合 計			株 数、金 額	278,150.8	—	99,506,241	
			銘 柄 数 < 比 率 >	1,253 銘柄		<96.1%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国投資信託証券

銘柄		2018年6月15日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC		3.447	579	64,163
SIMON PROPERTY GROUP INC		7.687	1,261	139,573
BOSTON PROPERTIES INC		3.75	449	49,756
GGP INC		16.7	346	38,316

銘	柄	2018年6月15日現在		
		□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
		千口	千アメリカ・ドル	千円
VORNADO REALTY TRUST		4.047	291	32,223
SBA COMMUNICATIONS CORP		2.85	447	49,523
EQUITY RESIDENTIAL		8.85	564	62,444
EQUINIX INC		1.918	760	84,221
AMERICAN TOWER CORP		10.85	1,501	166,141
HOST HOTELS & RESORTS INC		18.593	396	43,894
KIMCO REALTY CORP		10	165	18,295
INVITATION HOMES INC		7.4	165	18,362
VENTAS INC		8.7	473	52,392
WEYERHAEUSER CO		18.264	680	75,319
AGNC INVESTMENT CORP		9.9	188	20,818
CROWN CASTLE INTL CORP		9.8	991	109,735
IRON MOUNTAIN INC		6.76	229	25,431
VEREIT INC		24.4	176	19,552
PROLOGIS INC		13.062	841	93,132
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		2.37	302	33,486
CAMDEN PROPERTY TRUST		2.35	211	23,450
DUKE REALTY CORP		8.7	248	27,491
ESSEX PROPERTY TRUST INC		1.58	371	41,065
FEDERAL REALTY INVS TRUST		1.85	224	24,794
WELLTOWER INC		9.2	530	58,692
HCP INC		11.3	269	29,853
LIBERTY PROPERTY TRUST		3.6	159	17,643
MID-AMERICA APARTMENT COMM		2.75	266	29,484
MACERICH CO/THE		2.9	162	18,012
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		28.1	295	32,718
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		3.75	158	17,502
REALTY INCOME CORP		6.75	357	39,588
PUBLIC STORAGE		3.85	825	91,385
REGENCY CENTERS CORP		3.7	222	24,575
SL GREEN REALTY CORP		2.4	234	25,989
UDR INC		6.8	252	27,922
DIGITAL REALTY TRUST INC		4.95	527	58,418
EXTRA SPACE STORAGE INC		3	292	32,383
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金 額	296.878	16,423	1,817,757
	銘 柄 数 < 比 率 >	38 銘柄		<1.8%>
(カナダ)		千口	千カナダ・ドル	千円
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		1.5	45	3,823
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		3.7	74	6,277
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		3.9	93	7,853
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金 額	9.1	212	17,955
	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
LENDLEASE GROUP		14.9	281	23,241
TRANSURBAN GROUP		55.4	660	54,500
SYDNEY AIRPORT		27.5	199	16,499
APA GROUP		29.2	280	23,158
SCENTRE GROUP		135.822	571	47,191
DEXUS		25.85	248	20,480
GPT GROUP		44.06	220	18,217
MIRVAC GROUP		91.4	203	16,821
STOCKLAND		61.5	255	21,063

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2018年6月15日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
GOODMAN GROUP VICINITY CENTRES		千口 43.9 83.173	千オーストラリア・ドル 416 219	千円 34,382 18,121
オーストラリア・ドル通貨計		612.705	3,558	293,679
□数、金額 銘柄数<比率>		11銘柄		<0.3%>
(香港) LINK REIT HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS HKT TRUST AND HKT LTD-SS		千口 54.5 64.5 99	千香港ドル 3,891 480 991	千円 54,867 6,775 13,986
香港ドル通貨計		218	5,363	75,629
□数、金額 銘柄数<比率>		3銘柄		<0.1%>
(シンガポール) CAPITALAND COMMERCIAL TRUST ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT CAPITALAND MALL TRUST SUNTEC REIT		千口 60.1 62.5 63.2 63	千シンガポール・ドル 98 163 128 107	千円 8,101 13,460 10,545 8,803
シンガポール・ドル通貨計		248.8	497	40,911
□数、金額 銘柄数<比率>		4銘柄		<0.0%>
(イギリス) LAND SECURITIES GROUP PLC SEGRO PLC HAMMERSON PLC BRITISH LAND CO PLC		千口 18.062 25.75 19.2 23.4	千イギリス・ポンド 172 172 102 161	千円 25,263 25,302 15,076 23,748
イギリス・ポンド通貨計		86.412	609	89,390
□数、金額 銘柄数<比率>		4銘柄		<0.1%>
ユーロ (フランス) UNIBAIL GROUP STAPLED ICADE GECINA SA KLEPIERRE COVIVIO		千口 3.46 0.8 1.25 5.65 0.85	千ユーロ 662 65 179 188 76	千円 84,745 8,410 22,958 24,121 9,740
ユーロ通貨計		12.01	1,172	149,976
□数、金額 銘柄数<比率>		5銘柄		<0.1%>
ファンド合計		1,483.905	—	2,485,300
□数、金額 銘柄数<比率>		68銘柄		<2.4%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別		2018年6月15日現在	
		買建額	売建額
外国	S&P500 E-MINI FUTURE	百万円	百万円
	(アメリカ)	1,543	—

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

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第18期 (決算日 2017年11月30日)

(計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

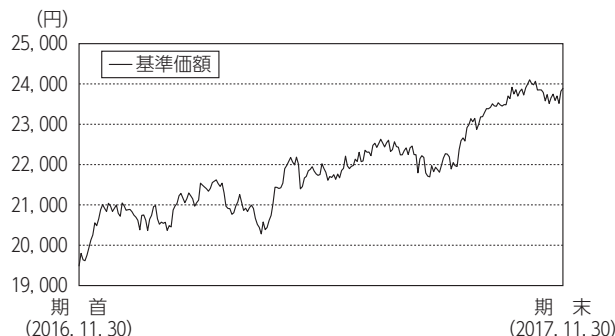
大和投資信託

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

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：19,489円 期末：23,891円 騰落率：22.6%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外株式市況

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

○為替相場

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

外国株式を中心に、S & P 500先物取引も一部利用し、株式組入比率(投資信託証券、株式先物を含む。)につきましては、期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

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

(注 2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 3,341.7 (253.89)	千アメリカ・ドル 22,389 (△ 3,456)	百株 4,430.91	千アメリカ・ドル 24,071
	カナダ	百株 607 (11.11)	千カナダ・ドル 2,885 (—)	百株 483.78	千カナダ・ドル 1,615
	オーストラリア	百株 740.5 (△1,811.25)	千オーストラリア・ドル 1,299 (△ 1,196)	百株 907	千オーストラリア・ドル 1,128
	香港	百株 1,952 (△ 28.42)	千香港ドル 2,314 (△ 879)	百株 1,665.06	千香港ドル 3,294
	シンガポール	百株 602 (—)	千シンガポール・ドル 190 (—)	百株 877	千シンガポール・ドル 172
	ニュージーランド	百株 35 (—)	千ニュージーランド・ドル 29 (—)	百株 —	千ニュージーランド・ドル —
	イギリス	百株 5,229.5 (△2,434.83)	千イギリス・ポンド 2,998 (△ 31)	百株 2,972.1	千イギリス・ポンド 1,962
	イスラエル	百株 45 (—)	千イスラエル・シェケル 609 (—)	百株 146	千イスラエル・シェケル 235
	スイス	百株 265 (30.6)	千スイス・フラン 1,365 (△ 196)	百株 210.96	千スイス・フラン 2,709

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	デンマーク	百株 119 (—)	千デンマーク・クローネ 3,015 (—)	百株 50.7	千デンマーク・クローネ 1,613
	ノルウェー	百株 45 (—)	千ノルウェー・クローネ 671 (△ 115)	百株 60	千ノルウェー・クローネ 599
	スウェーデン	百株 230 (155)	千スウェーデン・クローネ 3,578 (△ 11)	百株 393.5	千スウェーデン・クローネ 4,178
	ユーロ (アイルランド)	百株 (△ 6,397.4)	千ユーロ — (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オランダ)	百株 202 (△ 2.02)	千ユーロ 537 (△ 7)	百株 118.8	千ユーロ 343
	ユーロ (ベルギー)	百株 11.8 (22.5)	千ユーロ 104 (—)	百株 19.2	千ユーロ 131
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 24.7 (△ 282)	千ユーロ 149 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (フランス)	百株 398.9 (△ 16.05)	千ユーロ 1,594 (△ 32)	百株 180.4	千ユーロ 1,360
	ユーロ (ドイツ)	百株 450.5 (362.5)	千ユーロ 1,495 (△ 45)	百株 546.9	千ユーロ 1,120
国	ユーロ (ポルトガル)	百株 13 (—)	千ユーロ 17 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (スペイン)	百株 987 (△1,561.17)	千ユーロ 726 (△ 27)	百株 1,271.23	千ユーロ 337
	ユーロ (イタリア)	百株 1,265 (△2,185.15)	千ユーロ 905 (△ 25)	百株 751.68	千ユーロ 407
	ユーロ (フィンランド)	百株 139.5 (—)	千ユーロ 118 (—)	百株 115	千ユーロ 113
	ユーロ (オーストリア)	百株 10 (—)	千ユーロ 27 (△ 6)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (その他)	百株 — (51)	千ユーロ — (—)	百株 58	千ユーロ 174
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 3,502.4 (△10,007.79)	千ユーロ 5,677 (△ 144)	百株 3,061.21	千ユーロ 3,989

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

外国株式インデックスマザーファンド

(2) 投資信託証券

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

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

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

■主要な売買銘柄
株 式

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

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

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		40. 28	40. 28		5, 497	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		134	129	513	57, 485	生活必需品
BUNGE LTD		31	31	205	23, 071	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD		82. 25	82. 25	775	86, 861	情報技術
APPLE INC		1, 239	1, 189	20, 151	2, 257, 938	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		94	86	593	66, 500	金融
BOEING CO/THE		135	130. 5	3, 514	393, 784	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP		34. 65	34. 65	259	29, 068	金融
SPECTRA ENERGY CORP		159. 96	—	—	—	その他
BECTON DICKINSON AND CO		48. 87	51. 87	1, 176	131, 863	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR		—	60	155	17, 378	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC		—	33	205	23, 069	情報技術
CDK GLOBAL INC		29	29	200	22, 424	情報技術
NISOURCE INC		73	73	198	22, 224	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		33. 5	33. 5	283	31, 714	資本財・サービス
CR BARD INC		16. 8	16. 8	565	63, 402	ヘルスケア
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		250. 71	236. 71	1, 287	144, 313	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC		936. 04	934. 04	4, 660	522, 249	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		275. 5	285. 5	5, 420	607, 335	金融
ANSYS INC		21	19	278	31, 206	情報技術
H&R BLOCK INC		51	51	131	14, 783	一般消費財・サービス
BB&T CORP		190	187. 5	921	103, 198	金融
BAKER HUGHES INC		95. 73	—	—	—	その他
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		387	378. 5	2, 380	266, 764	ヘルスケア
EDGEWELL PERSONAL CARE CO		13	—	—	—	生活必需品
JPMORGAN CHASE & CO		826. 7	813. 2	8, 435	945, 178	金融
T ROWE PRICE GROUP INC		56	56	567	63, 544	金融
CIGNA CORP		59	59	1, 214	136, 073	ヘルスケア
LKQ CORP		68	72	284	31, 867	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD		10	10	136	15, 288	金融
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP		258. 42	—	—	—	電気通信サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		50	45. 5	269	30, 181	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC		69	64	276	30, 950	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC		39. 6	34. 6	565	63, 411	金融
DOLLAR GENERAL CORP		65	62	549	61, 606	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC		38	39. 5	476	53, 372	情報技術
CATERPILLAR INC		134	135	1, 863	208, 839	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP		64	64	317	35, 576	公益事業
MOSAIC CO/THE		75. 5	75. 5	184	20, 633	素材
DELTA AIR LINES INC		44	44	229	25, 686	資本財・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO		43. 5	—	—	—	その他
CORNING INC		247	213	691	77, 518	情報技術
CISCO SYSTEMS INC		1, 159	1, 141	4, 276	479, 178	情報技術
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS		200	—	—	—	その他
MORGAN STANLEY		333	318	1, 631	182, 862	金融
WABCO HOLDINGS INC		12. 5	12. 5	187	20, 985	資本財・サービス
DOW CHEMICAL CO/THE		258	—	—	—	その他
MSCI INC		22	21. 5	274	30, 771	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC		—	9	183	20, 555	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP		—	13	162	18, 254	資本財・サービス
COTY INC-CL A		111. 39	111. 39	190	21, 330	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		—	41	168	18, 831	情報技術
BROADCOM LTD		90. 62	91. 52	2, 484	278, 418	情報技術

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
UNITED THERAPEUTICS CORP		10. 5	10. 5	135	15, 191	ヘルスケア
DICK'S SPORTING GOODS INC		20	20	58	6, 601	一般消費財・サービス
ACUITY BRANDS INC		10	10	170	19, 098	資本財・サービス
ARAMARK		53. 5	58. 5	249	27, 910	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		49	49	183	20, 616	素材
DTE ENERGY COMPANY		42	41. 5	475	53, 271	公益事業
CENTENE CORP		40	40	396	44, 376	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC		—	24	290	32, 520	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP		122	116	471	52, 862	金融
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS		43	—	—	—	その他
ARTHUR J GALLAGHER & CO		40. 5	40. 5	269	30, 141	金融
GARTNER INC		19	21	250	28, 074	情報技術
SPLUNK INC		29	32	254	28, 501	情報技術
WHITEWAVE FOODS CO		41	—	—	—	その他
AGCO CORP		17	14. 5	102	11, 519	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC		143	143	1, 201	134, 594	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP		93	93	575	64, 493	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP		34	34	212	23, 810	資本財・サービス
DEERE & CO		62	61. 5	912	102, 291	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC		36	36	356	39, 918	情報技術
TIME WARNER INC		176. 33	176. 33	1, 603	179, 637	一般消費財・サービス
VMWARE INC-CLASS A		19	16. 5	197	22, 078	情報技術
TEGNA INC		45	—	—	—	一般消費財・サービス
NASDAQ INC		27	27	212	23, 767	金融
VAIL RESORTS INC		—	9. 5	212	23, 826	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC		—	34	209	23, 452	金融
TARGA RESOURCES CORP		—	50. 5	210	23, 613	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		—	15	246	27, 592	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC		—	18	189	21, 231	金融
CONSOLIDATED EDISON INC		70	70	618	69, 336	公益事業
MEDNAX INC		20	22	110	12, 369	ヘルスケア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP		26	24	269	30, 191	一般消費財・サービス
TELEFLEX INC		—	10	264	29, 627	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		21	21	228	25, 563	資本財・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		—	25	147	16, 493	ヘルスケア
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR		—	17. 5	115	12, 914	資本財・サービス
IDEX CORP		—	18	238	26, 723	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO		194. 5	191. 5	1, 378	154, 515	生活必需品
ROLLINS INC		—	22	101	11, 366	資本財・サービス
AMETEK INC		52. 25	52. 25	374	41, 965	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC		58	58	271	30, 408	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION		—	32	133	14, 969	資本財・サービス
LYONDELLBASELL INDU-CL A		84	79. 5	834	93, 542	素材
COSTCO WHOLESALE CORP		101. 5	100. 5	1, 784	199, 916	生活必需品
SCANA CORP		31	31	135	15, 193	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP		12	13. 5	268	30, 046	金融
WR GRACE & CO		16	16	118	13, 230	素材
VALSPAR CORP/THE		17	—	—	—	その他
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		7	6	181	20, 302	一般消費財・サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP		76	76	202	22, 677	金融
UGI CORP		39	39	187	20, 971	公益事業
CUMMINS INC		37	37	608	68, 207	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC		136	163	1, 010	113, 255	情報技術

外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	期 首	当	期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SABRE CORP	46	46	91	10,215	情報技術
CDW CORP/DE	35.5	37.5	258	28,955	情報技術
SIGNATURE BANK	13	13	180	20,208	金融
COSTAR GROUP INC	—	8.5	256	28,749	情報技術
SVB FINANCIAL GROUP	—	12	272	30,519	金融
AMERCO	1.7	1.7	62	7,001	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	—	10	267	29,995	情報技術
HANESBRANDS INC	85	85	172	19,343	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	18	205	22,972	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	122	45.66	349	39,169	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	—	46	167	18,782	情報技術
DEXCOM INC	—	19	112	12,641	ヘルスケア
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	20.5	221	24,842	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	—	22.5	133	14,909	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	17.7	457	51,242	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	12	12	335	37,557	資本財・サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	29.5	—	—	—	不動産
NIELSEN HOLDINGS PLC	85	80	290	32,557	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	439.81	460.81	772	86,538	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	71	68	544	61,061	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	105.5	105.5	307	34,482	エネルギー
T-MOBILE US INC	67.5	68.5	423	47,457	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	25	25	102	11,448	情報技術
COCA-COLA CO/THE	946.5	929.5	4,229	473,884	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	40	40	257	28,868	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	25	25	136	15,303	金融
FMC TECHNOLOGIES INC	49	—	—	—	その他
FRANKLIN RESOURCES INC	87	76	327	36,728	金融
CSX CORP	222	209.5	1,140	127,795	資本財・サービス
FLUOR CORP	33	33	159	17,822	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	23.5	23.5	368	41,346	ヘルスケア
EXPEDIA INC	28.75	28.75	350	39,307	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	20	20	253	28,420	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	92.1	93	10,799	1,210,118	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	—	50	131	14,768	エネルギー
FLOWSERVE CORP	29	29	120	13,488	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49	49	570	63,892	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	953.05	971.05	7,988	895,148	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	31	31	144	16,172	情報技術
AES CORP	156	156	165	18,546	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	18	18	353	39,622	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	10	9	200	22,462	金融
EOG RESOURCES INC	126.5	132.5	1,331	149,208	エネルギー
EQT CORP	40.5	40.5	235	26,370	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	42	39	215	24,183	情報技術
AMERISOURCEBERGEN CORP	44	38	321	36,047	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	77.9	72.9	500	56,109	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	851.23	853.23	1,071	120,079	一般消費財・サービス
TESARO INC	—	9	74	8,375	ヘルスケア
MACY'S INC	73.98	68.98	165	18,534	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	34.4	34.4	64	7,273	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	62.87	48.87	157	17,676	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	58.2	51.2	91	10,200	一般消費財・サービス

銘柄	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MOBILEYE NV		39	—	—	—	その他
TARO PHARMACEUTICAL INDUS		3	3	33	3,703	ヘルスケア
AERCAP HOLDINGS NV		38	38	196	22,030	資本財・サービス
FORTINET INC		31	35	145	16,251	情報技術
MARKEL CORP		3.2	3.2	353	39,575	金融
NEXTERA ENERGY INC		105.5	107	1,688	189,155	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC		271.08	318.08	445	49,932	素材
US BANCORP		395	387	2,119	237,457	金融
UNITED RENTALS INC		22	19	299	33,603	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC		16	14.5	188	21,098	情報技術
FASTENAL CO		65	65	333	37,319	資本財・サービス
FISERV INC		52	49.5	637	71,394	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO		2,056	1,991	3,679	412,273	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN		36.5	43.5	240	26,949	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO		61.5	56.5	181	20,347	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO		319	311	1,362	152,667	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC		27.5	27.5	95	10,652	一般消費財・サービス
LINKEDIN CORP - A		26	—	—	—	その他
GENERAL DYNAMICS CORP		60.5	59	1,204	134,975	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC		83	81.6	1,969	220,682	金融
ALPHABET INC-CL A		67.6	68.1	7,064	791,583	情報技術
ALPHABET INC-CL C		70.97	71.47	7,301	818,167	情報技術
GENERAL MILLS INC		136	130	732	82,067	生活必需品
FIRSTENERGY CORP		99.68	99.68	335	37,606	公益事業
GENUINE PARTS CO		35	35	320	35,884	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD		82.34	95.34	421	47,175	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP		175	175	533	59,728	金融
HARRIS CORP		29.5	27.5	393	44,131	情報技術
AMERICAN AIRLINES GROUP INC		30	30	147	16,555	資本財・サービス
HALLIBURTON CO		197.5	198.5	819	91,859	エネルギー
HOME DEPOT INC		281.5	273.5	4,847	543,194	一般消費財・サービス
ASSURANT INC		14	12.5	127	14,245	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC		246	246	356	39,913	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		—	11	263	29,541	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE		33	33	364	40,859	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC		45	40	195	21,952	一般消費財・サービス
HUMANA INC		35	33	825	92,489	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV		68	82	926	103,825	情報技術
HELMERICH & PAYNE		26	26	148	16,617	エネルギー
HENRY SCHEIN INC		19	36	253	28,357	ヘルスケア
HP INC		407	389	833	93,407	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE		377	377	526	59,013	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C		45	40	163	18,331	一般消費財・サービス
HOLLYFRONTIER CORP		39	39	172	19,371	エネルギー
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A		21	21	85	9,602	一般消費財・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD		28	29	279	31,269	金融
HARMAN INTERNATIONAL		16	—	—	—	その他
KRAFT HEINZ CO/THE		139.53	138.53	1,123	125,870	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP		209.5	204.5	3,140	351,847	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO		91	91	505	56,611	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI		36	36	240	26,974	資本財・サービス
ZOETIS INC		107	114	816	91,472	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC		60.29	57.79	497	55,733	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額		
			千アメリカ・ドル	千円	
CHENIERE ENERGY INC	47	47	225	25,278	エネルギー
ALLEGION PLC	—	22	182	20,445	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	31	31	149	16,707	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	145.23	130.23	407	45,630	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	24.37	—	—	—	一般消費財・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	41.05	61.57	425	47,671	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	82	89	263	29,528	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	27.2	27.2	320	35,859	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	624	614	8,584	961,874	ヘルスケア
ABBVIE INC	373.79	364.29	3,490	391,124	ヘルスケア
HOLOGIC INC	57.5	65.5	276	31,023	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	83.5	81.5	970	108,799	生活必需品
KROGER CO	212	206	502	56,274	生活必需品
KLA-TENCOR CORP	37	36.5	366	41,041	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	61.5	60	1,924	215,646	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	21	21	376	42,241	情報技術
L BRANDS INC	56	56	294	32,961	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	205	197	1,641	183,875	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	227.5	225.5	1,915	214,670	ヘルスケア
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	69	—	—	—	その他
LAM RESEARCH CORP	37	37	720	80,694	情報技術
RANGE RESOURCES CORP	43	57	102	11,496	エネルギー
JONES LANG LASALLE INC	10	10	151	16,993	不動産
LOEWS CORP	65	65	327	36,656	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	54.49	51.49	394	44,165	金融
MCDONALD'S CORP	194	185.5	3,161	354,243	一般消費財・サービス
3M CO	139	137	3,260	365,365	資本財・サービス
FACEBOOK INC-A	531.5	541.5	9,483	1,062,602	情報技術
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	52.54	48.04	374	41,981	情報技術
MANPOWERGROUP INC	17	15	194	21,817	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	61.5	59.5	980	109,825	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	14	14	291	32,708	素材
CONCHO RESOURCES INC	32.5	34.5	474	53,157	エネルギー
ENVISION HEALTHCARE CORP	—	26.36	83	9,401	ヘルスケア
FIRST DATA CORP- CLASS A	—	103	166	18,662	情報技術
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	—	43	152	17,032	電気通信サービス
PHILLIPS 66	110	99.5	944	105,814	エネルギー
MURPHY OIL CORP	36	36	101	11,343	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	—	100	275	30,892	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	108	107.5	361	40,532	一般消費財・サービス
MATTEL INC	78	78	142	15,941	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	—	65.38	624	69,976	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	26.5	26.5	270	30,322	生活必需品
MYLAN NV	104.5	104.5	385	43,160	ヘルスケア
METLIFE INC	213.5	208.5	1,116	125,105	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	105	91	202	22,646	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	—	11	257	28,867	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	—	25	124	13,944	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	36.78	38.28	360	40,392	情報技術
MONSANTO CO	100.56	100.56	1,183	132,632	素材
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	6	375	42,048	ヘルスケア
BAKER HUGHES A GE CO	—	91.73	275	30,814	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	29.5	29.5	560	62,846	資本財・サービス

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	—	19.4	115		12,920	金融
MERCK & CO. INC.	638.71	627.71	3,475		389,374	ヘルスケア
DOWDUPONT INC	—	535.05	3,840		430,337	素材
MASCO CORP	74	74	311		34,850	資本財・サービス
M & T BANK CORP	33.69	31.69	535		60,048	金融
MARSH & MCLENNAN COS	121.5	117.5	982		110,066	金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	75.22	74.72	945		105,902	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	26.5	29.5	314		35,216	情報技術
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	39.5	35.5	208		23,329	一般消費財・サービス
VANTIV INC - CL A	35.5	38.5	278		31,168	情報技術
NETAPP INC	67	61.5	345		38,748	情報技術
NIKE INC -CL B	305.5	300.5	1,813		203,238	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	67.5	67	913		102,407	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	48.5	53.5	463		51,901	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	30	30	265		29,715	金融
ALLY FINANCIAL INC	102	102	271		30,469	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	39.5	38.3	1,174		131,616	資本財・サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	62	62	632		70,895	一般消費財・サービス
NEWMONT MINING CORP	120	120	439		49,212	素材
MCKESSON CORP	51.5	49	725		81,324	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	64	64	333		37,369	情報技術
XYLEM INC	42	42	286		32,095	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	358.5	356	3,655		409,588	生活必需品
NUCOR CORP	71.5	74	424		47,561	素材
WESTERN UNION CO	113.46	113.46	223		25,044	情報技術
NEWELL BRANDS INC	101.42	108.92	332		37,235	一般消費財・サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	175.5	174	1,216		136,281	エネルギー
LIBERTY BROADBAND-C	26	25.5	223		25,092	一般消費財・サービス
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	—	6	69		7,736	生活必需品
PAYCHEX INC	75.5	75.5	502		56,325	情報技術
PATTERSON COS INC	19	19	70		7,866	ヘルスケア
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	22	21.2	500		56,136	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	450.5	442.5	2,981		334,034	生活必需品
P G & E CORP	115	116	638		71,565	公益事業
PFIZER INC	1,396.63	1,363.63	4,937		553,269	ヘルスケア
ALKERMES PLC	36	36	185		20,753	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	115	115	589		66,052	公益事業
STRYKER CORP	78.5	76.5	1,178		132,091	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	30.5	30.5	562		62,991	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	37.5	39	589		66,056	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	14	14	180		20,245	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	581.67	586.17	5,239		587,050	生活必需品
EXELON CORP	213.22	212.22	884		99,135	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	51	51	547		61,357	ヘルスケア
NVR INC	—	0.8	277		31,090	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	286.5	282.5	1,433		160,581	エネルギー
PEPSICO INC	327	326	3,808		426,796	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	102	99	1,147		128,534	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	40.5	40.5	365		41,001	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	145.5	142	2,086		233,813	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	22	19.5	104		11,702	金融
PENTAIR PLC	40.05	40.05	277		31,108	資本財・サービス
QUALCOMM INC	336.5	336	2,235		250,439	情報技術

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額		
			千アメリカ・ドル	千円	
INVESCO LTD	98.5	91.5	330	37,011	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	17	17	169	19,038	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	66	66	472	52,905	金融
RAYTHEON COMPANY	69	67	1,263	141,573	資本財・サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	18	20.5	166	18,690	一般消費財・サービス
RED HAT INC	42	40	497	55,796	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	18.1	18.1	649	72,733	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	56.5	53.5	344	38,551	資本財・サービス
PRICELINE GROUP INC/THE	11.4	11.2	1,942	217,666	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	94	90	683	76,591	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	21	21	241	27,081	素材
RESMED INC	32.5	32.5	277	31,044	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	33	31	301	33,808	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	28	28	159	17,826	資本財・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	196.78	—	—	—	その他
RITE AID CORP	230	—	—	—	生活必需品
RALPH LAUREN CORP	13	13	123	13,787	一般消費財・サービス
AUTONATION INC	17	17	94	10,545	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	29	36.63	483	54,169	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	288.35	274.35	454	50,937	金融
CHEVRON CORP	433.18	432.18	5,064	567,453	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	75	75	610	68,414	公益事業
TESLA INC	26.7	30.4	934	104,757	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	147	139	397	44,497	情報技術
ENDO INTERNATIONAL PLC	46	—	—	—	ヘルスケア
STANLEY BLACK & DECKER INC	34.72	34.72	581	65,206	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	34	34	295	33,056	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	48.85	49.05	1,626	182,287	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	71	71	305	34,200	不動産
TWITTER INC	130	144	299	33,545	情報技術
NAVIENT CORP	87	71	91	10,206	金融
SOUTHERN CO/THE	217.5	225.5	1,152	129,090	公益事業
SYSCO CORP	124	118	680	76,290	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	67.23	64.73	870	97,574	金融
SOUTHWESTERN ENERGY CO	110	—	—	—	エネルギー
SEI INVESTMENTS COMPANY	32	32	223	25,020	金融
STERICYCLE INC	19.5	19.5	127	14,265	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	—	57	215	24,187	素材
SCHLUMBERGER LTD	322.02	316.52	1,967	220,421	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	39	39	195	21,919	資本財・サービス
AT&T INC	1,414.91	1,402.91	5,117	573,451	電気通信サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	38	34	200	22,431	資本財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18.3	19.3	760	85,196	素材
SEMPRA ENERGY	54	54	649	72,765	公益事業
TIFFANY & CO	28	28	259	29,036	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	70	71	275	30,827	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	230	227.5	2,204	246,960	情報技術
SALESFORCE.COM INC	147	154.5	1,599	179,228	情報技術
SIGNET JEWELERS LTD	17	13	68	7,629	一般消費財・サービス
WESTROCK CO	59.3	59.3	357	40,040	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	217.84	215.84	822	92,120	資本財・サービス
ANDEAVOR	28.5	34.5	362	40,648	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	189	186	2,286	256,222	資本財・サービス

銘柄	株数	株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額		
			千アメリカ・ドル	千円	
MARATHON OIL CORP	190	190	280	31,402	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	123	119	730	81,870	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	182.5	174.5	2,061	231,034	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	159.5	157	1,868	209,413	資本財・サービス
UNUM GROUP	54	54	304	34,138	金融
SPRINT CORP	177.65	177.65	107	12,082	電気通信サービス
ANTERO RESOURCES CORP	34	51	95	10,720	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	34.94	31.94	323	36,257	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	50	45	197	22,150	金融
AMEREN CORPORATION	55	55	350	39,244	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	220.26	220.76	4,920	551,319	ヘルスケア
VERISIGN INC	22	22	252	28,284	情報技術
VALERO ENERGY CORP	107.92	103.42	861	96,576	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	13.9	13.1	292	32,747	一般消費財・サービス
FNF GROUP	57.38	57.38	230	25,852	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	20	20	214	24,084	ヘルスケア
ANTHEM INC	60.5	60.5	1,375	154,094	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	347	358.5	3,772	422,748	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	1,107.72	1,084.72	6,148	688,905	金融
FOOT LOCKER INC	32	32	136	15,271	一般消費財・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	103	100	826	92,575	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	167	187	529	59,339	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	31	31	215	24,092	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	17	17	287	32,190	一般消費財・サービス
WAL-MART STORES INC	351.5	346.5	3,380	378,779	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	46	46	535	60,057	ヘルスケア
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	195	221	71	7,973	エネルギー
WYNN RESORTS LTD	18	19.5	304	34,100	一般消費財・サービス
XEROX CORP	192.44	48.11	140	15,794	情報技術
WABTEC CORP	21	19	146	16,392	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	153.5	148.5	1,110	124,429	一般消費財・サービス
WATERS CORP	18	18	352	39,466	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	20	18	111	12,522	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	90.57	76.57	1,345	150,736	ヘルスケア
WHOLE FOODS MARKET INC	78	—	—	—	その他
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	212.5	211	1,517	170,037	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	30.83	29.83	474	53,168	金融
WESTERN DIGITAL CORP	64.5	67.5	546	61,263	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	73.8	71.3	493	55,332	公益事業
WESTAR ENERGY INC	32	32	180	20,183	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	117.5	117.5	619	69,384	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	429.5	423	4,647	520,705	情報技術
PPL CORP	154	154	563	63,173	公益事業
PULTEGROUP INC	74	67	226	25,382	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	61.5	59.5	696	78,010	素材
NORTHERN TRUST CORP	49	49	481	53,938	金融
NVIDIA CORP	124	136.5	2,681	300,420	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	113.93	110.93	1,550	173,680	金融
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	95.5	95.5	233	26,184	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	47	171	19,243	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	69	65	533	59,737	生活必需品
NETFLIX INC	98	99	1,862	208,713	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	90.5	89.5	1,723	193,168	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額		
			千アメリカ・ドル	千円	
TORCHMARK CORP	26.75	26.75	238	26,703	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	34	37	356	39,999	金融
TEXTRON INC	63.5	63.5	348	39,019	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	249.5	239.5	768	86,143	一般消費財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	103	103	322	36,123	一般消費財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	83.37	83.37	136	15,273	一般消費財・サービス
OGE ENERGY CORP	47	47	165	18,579	公益事業
OMNICOM GROUP	55	54	393	44,127	一般消費財・サービス
ORACLE CORP	702.83	707.33	3,431	384,551	情報技術
MASTERCARD INC - A	224.5	217.5	3,226	361,541	情報技術
ONEOK INC	49	88	443	49,725	エネルギー
CENTURYLINK INC	127.95	226.52	329	36,904	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	23	23	603	67,583	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	83	75	613	68,751	一般消費財・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	14	11.5	268	30,050	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	44	43.5	332	37,297	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	101	109	282	31,645	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	2,325.01	2,280.01	6,447	722,483	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	38	41	341	38,254	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	30	137	15,382	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	178	173.5	1,676	187,796	金融
ANALOG DEVICES INC	70	82.99	710	79,655	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	—	180	194	21,843	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	60	60	305	34,199	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	243.22	210.22	1,267	142,037	金融
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	14	—	—	—	素材
ANADARKO PETROLEUM CORP	127	127	608	68,134	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	44	41.5	437	48,979	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	40.5	40	498	55,890	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	45	45	135	15,177	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	25	25	55	6,199	ヘルスケア
AVERY DENNISON CORP	21	21	234	26,325	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	141.5	136	980	109,886	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	148.5	149	951	106,633	資本財・サービス
AON PLC	62	60	842	94,437	金融
AMGEN INC	174	168.5	2,902	325,177	ヘルスケア
CORE LABORATORIES N. V.	10	10	99	11,159	エネルギー
TAPESTRY INC	64	64	265	29,767	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	104.36	101.36	778	87,270	資本財・サービス
CELGENE CORP	179	178	1,835	205,671	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	41.2	38.8	831	93,193	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	245	245	1,296	145,249	情報技術
CIT GROUP INC	45	33	164	18,384	金融
CIMAREX ENERGY CO	22.5	22.5	257	28,798	エネルギー
CME GROUP INC	78	78	1,153	129,201	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	88.44	88.44	288	32,315	エネルギー
ECOLAB INC	61.5	59	796	89,247	素材
EQUIFAX INC	27.5	27.5	309	34,711	資本財・サービス
GAP INC/THE	58	58	188	21,121	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	306	300	2,210	247,641	ヘルスケア
ST JUDE MEDICAL INC	64.5	—	—	—	その他
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	43.98	41.48	371	41,579	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	68.5	68.5	246	27,623	生活必需品

銘柄	株数	株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額		
			千アメリカ・ドル	千円	
STATE STREET CORP	91.93	87.43	827	92,753	金融
STAPLES INC	156	—	—	—	その他
SUNTRUST BANKS INC	115.98	111.98	686	76,915	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	274	277	1,341	150,285	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	114	113.5	739	82,893	ヘルスケア
B/E AEROSPACE INC	23	—	—	—	その他
CAMPBELL SOUP CO	46	41	200	22,506	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	31	31	183	20,570	素材
CARDINAL HEALTH INC	75.5	71.5	422	47,356	ヘルスケア
FEDEX CORP	58.5	58.5	1,321	148,095	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	114.04	109.54	996	111,656	金融
FMC CORP	32	31.5	293	32,899	素材
FLEX LTD	122	122	220	24,756	情報技術
CERNER CORP	70	67	467	52,378	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	18	18	278	31,173	素材
CITRIX SYSTEMS INC	36.5	35	304	34,119	情報技術
INTEL CORP	1,084	1,079	4,742	531,364	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	88	88	176	19,770	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	91	82.5	475	53,292	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	74	70.5	1,169	131,037	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	450	385	210	23,640	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC	33.5	33.5	762	85,388	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	44	44	208	23,339	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	8.7	25.2	993	111,336	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	31	29	295	33,163	情報技術
SNAP-ON INC	13	13	217	24,358	資本財・サービス
CALPINE CORP	72	—	—	—	公益事業
CARMAX INC	46	42.5	291	32,620	一般消費財・サービス
COMERICA INC	40	40	333	37,420	金融
INGREDION INC	16	16	223	25,054	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	158.28	160.78	1,430	160,337	公益事業
TARGET CORP	129	119.5	737	82,589	一般消費財・サービス
DOVER CORP	35	35	335	37,593	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	13	13	281	31,575	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	29	29	188	21,066	資本財・サービス
CINTAS CORP	21	21	322	36,173	資本財・サービス
CA INC	71.05	71.05	231	25,937	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	95	95	353	39,598	生活必需品
CLOROX COMPANY	29.5	29.5	410	46,018	生活必需品
ENTERGY CORP	42.5	42	361	40,543	公益事業
MICROSOFT CORP	1,693.5	1,675.5	13,963	1,564,623	情報技術
INCYTE CORP	38.5	40.5	388	43,546	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	247.24	231.74	1,700	190,593	生活必需品
MEDTRONIC PLC	316.38	314.38	2,581	289,242	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	241	241	1,054	118,115	情報技術
BLACKROCK INC	28.5	27.5	1,377	154,321	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	91	91	269	30,253	公益事業
HASBRO INC	26	26	241	27,047	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	61	61	407	45,658	生活必需品
KEYCORP	245	247	469	52,612	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	24	24	264	29,613	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	356.11	350.11	1,503	168,452	生活必需品
KOHL'S CORP	44	39	186	20,844	一般消費財・サービス

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	
COOPER COS INC/THE		11	11	266	29,900	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP		111	111	149	16,765	金融
APACHE CORP		87.6	87.6	356	39,988	エネルギー
CHUBB LTD		107.99	106.49	1,625	182,133	金融
ARROW ELECTRONICS INC		20	20	160	17,999	情報技術
ALLSTATE CORP		87	83.5	851	95,395	金融
EBAY INC		250	234	804	90,143	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC		249.5	261.5	1,915	214,630	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO		35	32.5	297	33,288	素材
XILINX INC		59.5	56	388	43,534	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO		143.1	135.1	849	95,157	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP-A		53	53	271	30,453	一般消費財・サービス
YAHOO! INC		210	—	—	—	その他
ZIONS BANCORPORATION		—	48	237	26,617	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		51.5	51.5	638	71,514	生活必需品
TOLL BROTHERS INC		38	38	190	21,327	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC		59	59	244	27,395	情報技術
LINEAR TECHNOLOGY CORP		56	—	—	—	その他
LENNAR CORP-A		44	48	298	33,442	一般消費財・サービス
LEAR CORP		17	15.5	277	31,105	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP		65	65	310	34,799	金融
PROGRESSIVE CORP		134	134	702	78,752	金融
PRAXAIR INC		66	65	1,008	113,014	素材
PACCAR INC		79.87	79.87	551	61,760	資本財・サービス
PVH CORP		19	17.5	239	26,891	一般消費財・サービス
BIOGEN INC		50.8	48.8	1,561	174,955	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC		20	20	308	34,511	ヘルスケア
STARBUCKS CORP		336	331	1,903	213,296	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC		34	30.5	267	29,978	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY		74.8	71.3	460	51,617	公益事業
INTUIT INC		56	56	863	96,769	情報技術
BORGWARNER INC		48	48	263	29,505	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC		71	65	382	42,847	一般消費財・サービス
BALL CORP		37.92	75.84	300	33,617	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP		310.47	310.47	805	90,275	ヘルスケア
BED BATH & BEYOND INC		36	36	83	9,301	一般消費財・サービス
XL GROUP LTD		68	61	241	27,025	金融
ELECTRONIC ARTS INC		70.5	71	748	83,923	情報技術
VULCAN MATERIALS CO		30.5	30.5	380	42,671	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		56.5	56.5	812	91,005	ヘルスケア
VF CORP		77.5	77.5	574	64,373	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING		94.71	83.71	473	53,032	一般消費財・サービス
VIACOM INC-CLASS B		81.71	81.71	232	26,020	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC		15	14.7	410	45,971	一般消費財・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC		52	63	103	11,555	情報技術
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		22	22	244	27,416	ヘルスケア
CARNIVAL CORP		80.5	80.5	528	59,261	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A		545.7	1,084.4	4,032	451,884	一般消費財・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		—	52	221	24,838	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		58	48	310	34,846	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		265	265	191	21,468	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株 数、金 額	71,134.09	70,298.77	525,149	58,842,994	
	銘柄 数 < 比 率 >	584銘柄	600銘柄		<62.0%>	

銘柄	株数	株数	期末評価額		業種等
			当期		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)					
IMPERIAL OIL LTD	72	67	264	23,074	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4.4	4.4	332	28,938	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	46.96	46.96	152	13,240	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	53.87	51.87	429	37,435	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	107	107	284	24,753	素材
INTACT FINANCIAL CORP	31.5	31.5	341	29,763	金融
BCE INC	34.3	34.3	211	18,430	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	43	43	458	39,943	素材
SUNCOR ENERGY INC	393.3	388.3	1,723	150,097	エネルギー
METRO INC	55	55	221	19,315	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	77	81	516	44,997	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	282	279	2,279	198,538	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	91.5	101.5	1,165	101,490	金融
TORONTO-DOMINION BANK	437	432	3,242	282,392	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	67	67	237	20,699	金融
ROYAL BANK OF CANADA	348.5	340.5	3,451	300,668	金融
TOURMALINE OIL CORP	47	54	123	10,728	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	25	28	124	10,862	エネルギー
TRANSCANADA CORP	189.5	205.5	1,272	110,866	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	94	116.29	507	44,202	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	454	454	133	11,665	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	273	273	492	42,919	素材
CAE INC	58	58	130	11,391	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	78.04	67.04	382	33,283	金融
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	202	194	486	42,378	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	39	39	96	8,424	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	14	16	126	11,012	素材
VERESEN INC	80	—	—	—	その他
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6.9	34.5	206	17,999	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	97	97	94	8,212	金融
LINAMAR CORP	11	11	74	6,522	一般消費財・サービス
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	54	54	92	8,071	エネルギー
HYDRO ONE LTD	40	72	163	14,229	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	51.6	51.6	351	30,642	生活必需品
EMERA INC	—	13	62	5,478	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	28	28	108	9,416	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	86	86	579	50,486	電気通信サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	51	55	308	26,850	素材
KINROSS GOLD CORP	295	295	158	13,823	素材
BANK OF MONTREAL	152	153	1,521	132,516	金融
POWER CORP OF CANADA	87	81	265	23,161	金融
METHANEX CORP	22	22	147	12,834	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	—	19	253	22,076	情報技術
CAMECO CORP	92	92	108	9,415	エネルギー
TELUS CORP	54	54	259	22,599	電気通信サービス
POWER FINANCIAL CORP	56	57	202	17,634	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	134	134	390	33,998	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	17	16	260	22,703	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	208	248	94	8,208	素材
AGRIUM INC	31	33	460	40,133	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	255	261	1,116	97,274	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	5.4	6.4	446	38,893	金融

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	千カナダ・ドル	千円	
MAGNA INTERNATIONAL INC		93	84	595	51,902	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD		11	11	120	10,479	生活必需品
BLACKBERRY LTD		119	119	163	14,199	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC		142.5	142.5	725	63,163	金融
ENBRIDGE INC		220	381	1,743	151,821	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		205.5	207.5	1,103	96,113	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP		469	460	1,246	108,538	金融
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE		71	71	150	13,128	ヘルスケア
GOLDCORP INC		199.59	199.59	324	28,266	素材
ENCANA CORP		232	231	342	29,838	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		34	34	757	65,977	資本財・サービス
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC		22	25	147	12,877	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC		52	52	212	18,488	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO		183.5	175.5	1,723	150,109	資本財・サービス
CGI GROUP INC - CLASS A		53	50	340	29,618	情報技術
HUSKY ENERGY INC		75.58	84.58	129	11,249	エネルギー
ONEX CORPORATION		20	20	183	16,005	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		95	101	293	25,529	一般消費財・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC		39	39	118	10,309	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC		34	42	232	20,288	資本財・サービス
ELDORADO GOLD CORP		172	—	—	—	素材
IGM FINANCIAL INC		23	19	84	7,385	金融
OPEN TEXT CORP		28	62	260	22,670	情報技術
CI FINANCIAL CORP		54	64	183	15,948	金融
SAPUTO INC		58	48	210	18,307	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		171	158	229	19,968	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		98	98	642	55,977	生活必需品
YAMANA GOLD INC		233	233	79	6,900	素材
YAMANA GOLD INC-RTS		14.56	—	—	—	その他
FORTIS INC		96	99	469	40,898	公益事業
CRESCENT POINT ENERGY CORP		133	133	121	10,588	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC		196	240	283	24,708	エネルギー
DOLLARAMA INC		27	25	402	35,079	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I		17	17	77	6,759	公益事業
ALTAGAS LTD		39	39	113	9,861	エネルギー
FIRST CAPITAL REALTY INC		26	38	79	6,897	不動産
KEYERA CORP		40	44	157	13,708	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP		39	39	60	5,248	エネルギー
INTER PIPELINE LTD		81	88	236	20,625	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		83	83	131	11,494	エネルギー
カナダ・ドル通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	9,531 90銘柄	9,665.33 89銘柄	41,396 3,605,630 <3.8%>	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD		375	375	73	6,253	ヘルスケア
MEDIBANK PRIVATE LTD		617	617	199	16,913	金融
BHP BILLITON LIMITED		752	747	2,064	175,231	素材
SOUTH32 LTD		1,272	1,207	404	34,316	素材
LENDLEASE GROUP		121	—	—	—	不動産
ALUMINA LTD		699	569	131	11,155	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		182	176	548	46,529	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		397	355	164	13,919	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		118	118	134	11,456	金融

銘柄	期首 株数	当 株数	期末 評価額		業種等
			外貨建金額		
			千オーストラリア・ドル	千円	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	620	626	1,851	157,154	金融
WESTPAC BANKING CORP	780.98	788.48	2,482	210,658	金融
SANTOS LTD	340	428	220	18,707	エネルギー
AUSNET SERVICES	410	410	76	6,472	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	689	684	1,967	167,012	金融
RIO TINTO LTD	97	100	717	60,851	素材
ORIGIN ENERGY LTD	414	414	374	31,763	エネルギー
AMCOR LIMITED	267	268	417	35,391	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	468	468	243	20,653	資本財・サービス
VOCUS GROUP LTD	100	—	—	—	電気通信サービス
OIL SEARCH LTD	329	329	232	19,741	エネルギー
SEEK LTD	75	75	140	11,903	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	171	171	265	22,494	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	176	176	423	35,938	素材
INCITEC PIVOT LTD	456	382	152	12,903	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	401	405.5	3,283	278,690	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	60	60	204	17,344	エネルギー
ORICA LTD	83	83	142	12,116	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	328	323	344	29,249	金融
CIMIC GROUP LTD	29	21	109	9,283	資本財・サービス
WOOLWORTHS LTD	300	300	808	68,642	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	137	137	106	9,022	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	205	205	99	8,438	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	106	96	120	10,200	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	145.54	102.54	57	4,916	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	986	986	334	28,368	電気通信サービス
AMP LTD	665	668	346	29,367	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	114	103	222	18,855	素材
MACQUARIE GROUP LTD	72.84	76.84	766	65,064	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	126	126	297	25,236	一般消費財・サービス
BANK OF QUEENSLAND LTD	91	91	118	10,063	金融
CSL LTD	106	106	1,547	131,317	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	267.45	264.95	1,157	98,197	生活必需品
COCHLEAR LTD	14	14	257	21,826	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	—	134	186	15,842	素材
SUNCORP GROUP LTD	312	297	424	35,994	金融
BORAL LTD	227	277	210	17,843	素材
BORAL LTD-RTS	102.25	—	—	—	その他
ASX LTD	42	47	269	22,868	金融
COMPUTERSHARE LTD	139	104	172	14,598	情報技術
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	140	56	4,776	一般消費財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	549	549	396	33,687	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	95	95	212	18,020	ヘルスケア
TRANSURBAN GROUP	478	—	—	—	資本財・サービス
CHALLENGER LTD	122	139	194	16,515	金融
SYDNEY AIRPORT	251	—	—	—	資本財・サービス
TATTS GROUP LTD	369	305	132	11,234	一般消費財・サービス
AGL ENERGY LTD	152	155	392	33,321	公益事業
BRAMBLES LTD	373	373	382	32,447	資本財・サービス
APA GROUP	267	—	—	—	公益事業
DUET GROUP	500	—	—	—	その他
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	—	14	62	5,340	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	33	33	230	19,520	ヘルスケア
TPG TELECOM LTD	65	87	51	4,348	電気通信サービス

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	
REA GROUP LTD		百株 12	百株 12	千オーストラリア・ドル 96	千円 8,160	情報技術
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		14	14	65	5,571	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	18,405.06 63 銘柄	16,427.31 58 銘柄	27,144	2,303,720 <2.4%>	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		330	330	2,211	31,727	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		550	550	3,187	45,737	一般消費財・サービス
MTR CORP		345	345	1,585	22,748	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES		350	340	4,358	62,548	不動産
SINO LAND CO		880	740	1,025	14,717	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		631.69	631.69	6,149	88,245	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD		320	280	687	9,864	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		125	125	941	13,506	不動産
FIRST PACIFIC CO		—	560	322	4,620	金融
CLP HOLDINGS LTD		425	380	3,085	44,278	公益事業
CATHAY PACIFIC AIRWAYS		330	—	—	—	資本財・サービス
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		283.86	279.24	1,442	20,696	不動産
HANG LUNG GROUP LTD		—	210	567	8,136	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		1,811.42	1,912.56	2,922	41,936	公益事業
HANG SENG BANK LTD		179	179	3,399	48,778	金融
WHEELOCK & CO LTD		250	200	1,066	15,297	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT		1,290	1,330	1,497	21,490	不動産
WH GROUP LTD		1,350	1,945	1,624	23,305	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		273	273	6,552	94,021	金融
LI & FUNG LTD		1,320	1,320	456	6,553	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD		520	460	843	12,106	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		65	58	676	9,704	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		210	165	462	6,641	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD		465	355	491	7,050	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD		180	145	500	7,178	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		290.4	290.4	974	13,981	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO		140	140	560	8,036	不動産
SJM HOLDINGS LTD		470	470	297	4,276	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		300	262	687	9,869	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		641.69	616.69	4,030	57,831	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		150	150	1,007	14,454	公益事業
PCCW LTD		950	950	437	6,284	電気通信サービス
AIA GROUP LTD		2,830	2,812	18,545	266,122	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		—	280	1,334	19,145	不動産
SANDS CHINA LTD		572	572	2,196	31,519	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD		300	300	541	7,774	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		315	315	1,417	20,341	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD		200	200	403	5,783	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		875	875	3,403	48,843	金融
WYNN MACAU LTD		380	380	891	12,787	一般消費財・サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		570	—	—	—	電気通信サービス
香 港 ド ル 通 貨 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	21,468.06 38 銘柄	21,726.58 39 銘柄	82,783	1,187,943 <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		300	313	814	67,752	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD		415	415	1,023	85,135	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD		124.7	124.7	131	10,944	資本財・サービス

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	千シンガポール・ドル	千円	
KEPPEL CORP LTD		345	345	265	22,128	資本財・サービス
UOL GROUP LTD		132	132	116	9,652	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		112	112	134	11,208	不動産
CAPITALAND LTD		590	590	207	17,276	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING		—	420	64	5,345	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		410	410	111	9,311	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		30	23	91	7,645	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		742	742	912	75,924	金融
GENTING SINGAPORE PLC		1,530	1,530	208	17,310	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		1,886.5	1,886.5	705	58,694	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING		350	350	113	9,462	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		290	227	69	5,778	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		2,194	1,644	62	5,197	生活必需品
SATS LTD		—	160	83	6,921	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD		190	190	141	11,807	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD		468	468	95	7,942	資本財・サービス
STARHUB LTD		160	160	46	3,833	電気通信サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD		560	372	117	9,779	生活必需品
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L		690	630	210	17,504	不動産
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	11,519.2 20銘柄	11,244.2 22銘柄	5,728	476,557 <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	260	74	5,681	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD		526.89	526.89	189	14,504	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		234	234	152	11,698	資本財・サービス
CONTACT ENERGY LTD		130	130	71	5,502	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD		201	201	137	10,557	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD		53	88	91	7,017	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,404.89 6銘柄	1,439.89 6銘柄	716	54,963 <0.1%>	
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT		163	163	58	8,720	一般消費財・サービス
TUI AG-DI		117.47	102.47	137	20,734	一般消費財・サービス
BP PLC		4,363	4,607	2,278	342,476	エネルギー
UNILEVER PLC		301.1	301.1	1,269	190,834	生活必需品
BARCLAYS PLC		3,975	3,955	768	115,492	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		434	384	330	49,702	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC		381	381	119	17,892	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD		23	21.5	148	22,349	素材
PRUDENTIAL PLC		602	602	1,143	171,947	金融
INMARSAT PLC		103	103	49	7,492	電気通信サービス
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP		792.91	838.91	236	35,513	金融
JOHNSON MATTHEY PLC		45.64	45.64	139	20,987	素材
BAE SYSTEMS PLC		761	748	406	61,171	資本財・サービス
AVIVA PLC		939.66	960.66	488	73,507	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC		1,150.02	1,145.02	1,497	225,061	ヘルスケア
MICRO FOCUS INTERNATIONAL		—	100	249	37,552	情報技術
WORLDPAY GROUP PLC		427	471	196	29,596	情報技術
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC		80	80	43	6,494	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC		252	224	75	11,364	情報技術
DCC PLC		20	20	144	21,767	資本財・サービス
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITLE		19,964	—	—	—	その他

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額		
			千イギリス・ポンド	千円	
CONVATEC GROUP PLC	—	330	63	9,480	ヘルスケア
ROLLS-ROYCE HOLDINGS- ENTITL	—	17,664	1	265	その他
ROYAL MAIL PLC	224	224	97	14,708	資本財・サービス
RELX PLC	256.46	248.46	434	65,364	資本財・サービス
DIAGEO PLC	594	586	1,519	228,470	生活必需品
RIO TINTO PLC	291.5	287	1,009	151,783	素材
STANDARD CHARTERED PLC	783	779	583	87,713	金融
TESCO PLC	1,911	1,911	378	56,881	生活必需品
FRESNILLO PLC	50	50	65	9,793	素材
SMITH & NEPHEW PLC	215	203	266	40,007	ヘルスケア
GLENCORE PLC	2,909.25	2,851.25	976	146,805	素材
WOOD GROUP (JOHN) PLC	—	162	115	17,364	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	57	65	103	15,614	金融
SMITHS GROUP PLC	93.33	93.33	139	21,017	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	61	61	42	6,405	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	339.83	310.83	113	17,017	金融
DIXONS CARPHONE PLC	248	248	40	6,136	一般消費財・サービス
PEARSON PLC	188.63	188.63	133	20,076	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	381.25	381.25	89	13,503	生活必需品
NEXT PLC	33	33	148	22,338	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	739	739	144	21,796	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	43.11	43.11	156	23,550	一般消費財・サービス
IMI PLC	58.5	66.5	84	12,746	資本財・サービス
BUNZL PLC	77.55	77.55	163	24,575	資本財・サービス
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	206	—	—	—	その他
GKN PLC	406	406	126	18,999	一般消費財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	6,261.83	6,236.83	1,404	211,190	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	29.93	29.93	128	19,329	素材
KINGFISHER PLC	519.11	519.11	174	26,259	一般消費財・サービス
WPP PLC	298	298	390	58,685	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	159.27	159.27	129	19,393	公益事業
SEVERN TRENT PLC	57.33	57.33	122	18,348	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	149	157	1,023	153,836	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	119	119	144	21,681	金融
SCHRODERS PLC	32	28	96	14,542	金融
TATE & LYLE PLC	101	114	76	11,447	生活必需品
SSE PLC	238	239	325	48,935	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	48	54	108	16,268	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	227	227	138	20,782	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	298	297.5	1,457	219,143	ヘルスケア
FERGUSON PLC	59.65	59.65	319	48,019	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,436	1,381	370	55,721	金融
3I GROUP PLC	229.91	229.91	210	31,641	金融
SKY PLC	248	245	229	34,436	一般消費財・サービス
ASHTREAD GROUP PLC	122	114	219	33,058	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	261.14	256.14	199	29,995	情報技術
NATIONAL GRID PLC	888.28	802.34	706	106,141	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	15,039.65	16,729.65	1,122	168,754	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	242.6	242.6	147	22,155	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	226.5	226.5	689	103,715	生活必需品
CENTRICA PLC	1,283.6	1,283.6	183	27,555	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	30	30	115	17,327	一般消費財・サービス
PROVIDENT FINANCIAL PLC	36.5	36.5	32	4,856	金融
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	435.6	536.6	2,576	387,363	生活必需品

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	千イギリス・ポンド	千円	
NEX GROUP PLC		120	—	—	—	金融
BHP BILLITON PLC		501.77	495.77	669	100,614	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		85	81	243	36,676	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		4,633	4,695	3,489	524,550	金融
SHIRE PLC		210.74	209.74	779	117,182	ヘルスケア
OLD MUTUAL PLC		1,170.25	1,170.25	234	35,272	金融
ANGLO AMERICAN PLC		334.83	306.83	422	63,469	素材
MONDI PLC		83	83	146	22,072	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS		509	509	111	16,711	生活必需品
CARNIVAL PLC		45.11	45.11	219	32,950	一般消費財・サービス
EASYJET PLC		35	35	49	7,403	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC		388.41	373.89	566	85,153	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC		75.5	70.5	182	27,460	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC		2,000	1,966	502	75,483	電気通信サービス
COCA-COLA HBC AG-DI		44	44	105	15,788	生活必需品
WILLIAM HILL PLC		192	—	—	—	一般消費財・サービス
BURBERRY GROUP PLC		104.89	104.89	180	27,184	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		44.77	42.86	187	28,201	一般消費財・サービス
CAPITA PLC		150.9	150.9	74	11,224	資本財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC		59	59	93	14,066	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC		38	38	198	29,848	資本財・サービス
ITV PLC		868	868	137	20,669	一般消費財・サービス
PETROFAC LTD		56	—	—	—	エネルギー
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		75.49	71.99	273	41,178	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		1,000	1,043	2,467	370,975	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		881.18	872.18	2,106	316,642	エネルギー
MEGGITT PLC		177	177	86	12,963	資本財・サービス
G4S PLC		346	346	88	13,341	資本財・サービス
COBHAM PLC		386	556	71	10,765	資本財・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		33	33	33	5,099	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC		52	45	86	12,995	金融
INVESTEC PLC		145	160	82	12,447	金融
ANTOFAGASTA PLC		86	98	90	13,568	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		454.63	633.57	270	40,593	金融
EXPERIAN PLC		230.54	220.54	343	51,653	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	89,754.12 106銘柄	89,576.69 105銘柄	44,221	6,647,873 <7.0%>	
(イスラエル)		百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
AZRIELI GROUP LTD		10	10	186	5,970	不動産
FRUTAROM		—	9	270	8,660	素材
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		564	483	247	7,913	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD		140	140	196	6,268	素材
ELBIT SYSTEMS LTD		—	6	296	9,469	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM		265	245	585	18,725	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL		376	334	654	20,935	金融
NICE LTD		17	14	427	13,664	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		—	30	189	6,063	金融
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,372 6銘柄	1,271 9銘柄	3,054	97,670 <0.1%>	
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円	
DUFREY AG-REG		10.5	8.5	120	13,719	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG		860	855	1,454	165,549	金融

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			
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		2	2	129	14,729	素材		
ADECCO GROUP AG-REG		40	39	289	32,917	資本財・サービス		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		165	164.8	4,083	464,852	ヘルスケア		
PARGESA HOLDING SA-BR		8	9.5	79	9,051	金融		
SIKA AG-BR		0.54	0.5	378	43,113	素材		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.02	0.02	135	15,418	生活必需品		
ABB LTD-REG		439	464	1,165	132,676	資本財・サービス		
ARYZTA AG		21	—	—	—	生活必需品		
SWISS RE AG		78	75.5	701	79,796	金融		
NESTLE SA-REG		727	725.5	6,163	701,548	生活必需品		
PARTNERS GROUP HOLDING AG		4.2	4.2	281	32,031	金融		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		10	9.7	215	24,567	資本財・サービス		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		435.2	561.2	917	104,382	金融		
JULIUS BAER GROUP LTD		52	52	296	33,798	金融		
SGS SA-REG		1.3	1.3	312	35,544	資本財・サービス		
SCHINDLER HOLDING AG-REG		5	5	108	12,367	資本財・サービス		
VIFOR PHARMA AG		0.9	12	148	16,924	ヘルスケア		
SWATCH GROUP AG/THE-BR		7.5	7.4	264	30,164	一般消費財・サービス		
ZURICH INSURANCE GROUP AG		35.12	35.22	1,041	118,508	金融		
BALOISE HOLDING AG - REG		12	12	181	20,639	金融		
NOVARTIS AG-REG		522	517.5	4,331	493,051	ヘルスケア		
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.5	0.5	90	10,267	生活必需品		
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG		123.5	122	1,027	116,930	一般消費財・サービス		
SWISSCOM AG-REG		5.9	6.2	319	36,381	電気通信サービス		
GEBERIT AG-REG		9	8.5	362	41,266	資本財・サービス		
GIVAUDAN-REG		2.2	2.2	487	55,469	素材		
ACTELION LTD-REG		22.5	—	—	—	その他		
STRAUMANN HOLDING AG-REG		—	2.2	160	18,218	ヘルスケア		
SYNGENTA AG-REG		21.62	—	—	—	素材		
SONOVA HOLDING AG-REG		13	12	185	21,076	ヘルスケア		
LONZA GROUP AG-REG		13	17.5	445	50,716	ヘルスケア		
SWATCH GROUP AG/THE-REG		11	13	90	10,254	一般消費財・サービス		
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		108.4	105.4	569	64,787	素材		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		8	7.7	253	28,906	金融		
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		12.5	12.5	213	24,345	資本財・サービス		
SWISS PRIME SITE-REG		16	16.5	139	15,917	不動産		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.23	0.23	131	14,949	生活必需品		
スイス・フラン通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	3,803.63 38銘柄	3,888.27 36銘柄	27,276 3,104,842	<3.3%>		
(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			450	434	13,974	249,310	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S			163.5	175.5	4,171	74,421	金融	
ISS A/S			39	39	909	16,218	資本財・サービス	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A			0.95	0.85	890	15,891	資本財・サービス	
H LUNDBECK A/S			—	17	526	9,389	ヘルスケア	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S			52	50	1,959	34,957	資本財・サービス	
TDC A/S			193	193	726	12,959	電気通信サービス	
CARLSBERG AS-B			24.5	24.5	1,795	32,037	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES			55	52	1,730	30,873	素材	
COLOPLAST-B			28	28	1,374	24,526	ヘルスケア	
DSV A/S			46	45	2,151	38,373	資本財・サービス	
WILLIAM DEMANT HOLDING			33.75	26.75	462	8,251	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B			1.6	1.5	1,635	29,168	資本財・サービス	

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		
TRYG A/S		百株 —	百株 25	千デンマーク・クローネ 387	千円 6,913	金融	
PANDORA A/S		26.5	25.5	1,550	27,659	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S		23.5	23.5	1,297	23,142	素材	
GENMAB A/S		13	13	1,560	27,830	ヘルスケア	
ORSTED A/S		—	44.5	1,582	28,238	公益事業	
デンマーク・クローネ通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,150.3 15 銘柄	1,218.6 18 銘柄	38,686	690,163 <0.7%>	
(ノルウェー)			百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA			334	306	1,811	24,600	素材
DNB ASA			225.5	225.5	3,418	46,424	金融
ORKLA ASA			190.5	190.5	1,581	21,472	生活必需品
TELENOR ASA			178	180	3,312	44,976	電気通信サービス
STATOIL ASA			261.73	260.73	4,341	58,952	エネルギー
SCHIBSTED ASA-CL A			15	15	338	4,595	一般消費財・サービス
YARA INTERNATIONAL ASA			41.6	41.6	1,550	21,049	素材
MARINE HARVEST			87	99	1,402	19,050	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA			48.5	48.5	738	10,030	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS			18	18	377	5,121	一般消費財・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,399.83 10 銘柄	1,384.83 10 銘柄	18,871	256,273 <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			19	19	573	7,667	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS			722.3	710.3	3,778	50,560	情報技術
VOLVO AB-B SHS			345	366	5,793	77,520	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR			15	15	804	10,757	電気通信サービス
SKF AB-B SHARES			86.5	87.5	1,689	22,607	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B			54.5	54.5	1,491	19,951	一般消費財・サービス
NORDEA BANK AB			706.5	708.5	6,950	92,996	金融
SWEDISH MATCH AB			45.5	41.5	1,306	17,479	生活必需品
TELE2 AB-B SHS			89.5	89.5	959	12,837	電気通信サービス
GETINGE AB-B SHS			47	56	854	11,434	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A			341.5	350.5	3,462	46,334	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS			352	352	4,026	53,879	金融
SWEDBANK AB - A SHARES			213	209	4,165	55,732	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS			217	226	4,402	58,905	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B			141	—	—	—	素材
SKANSKA AB-B SHS			82.5	76.5	1,394	18,659	資本財・サービス
SANDVIK AB			244.5	262.5	3,816	51,068	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS			108	105.5	4,156	55,616	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS			157	157	5,725	76,611	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS			92	74	1,079	14,445	資本財・サービス
TELIA CO AB			600	600	2,202	29,462	電気通信サービス
ALFA LAVAL AB			70	70	1,399	18,722	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS			91	91	2,973	39,790	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B			233	233	3,991	53,403	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS			—	9	558	7,472	金融
LUNDIN PETROLEUM AB			64	42	816	10,930	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B			—	141	3,419	45,749	生活必需品
BOLIDEN AB			60	65	1,746	23,368	素材
HUSQVARNA AB-B SHS			125.5	97.5	748	10,012	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B			53	53	1,424	19,054	金融

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		
HEXAGON AB-B SHS		百株 62	百株 62	千スウェーデン・クローネ 2,548	千円 34,094	情報技術	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		35	40	816	10,928	金融	
スウェーデン・クローネ通貨計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	5,472.8 30 銘柄	5,464.3 31 銘柄	79,077	1,058,055 <1.1%>	
ユーロ (アイルランド)			百株	百株	千ユーロ	千円	
BANK OF IRELAND GROUP PLC			6,618	220.6	145	19,278	金融
KERRY GROUP PLC-A			38.5	38.5	337	44,796	生活必需品
CRH PLC			194	194	576	76,599	素材
PADDY POWER BETFAIR PLC			19	19	181	24,153	一般消費財・サービス
国 小 計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6,869.5 4 銘柄	472.1 4 銘柄	1,241	164,828 <0.2%>	
ユーロ (オランダ)			百株	百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N. V.			54.5	52.48	140	18,710	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV			218.76	214.76	696	92,512	ヘルスケア
NN GROUP NV			76	75	269	35,769	金融
UNILEVER NV-CVA			383.5	379.5	1,854	246,261	生活必需品
HEINEKEN NV			53	61	521	69,258	生活必需品
RELX NV			234.19	227.19	441	58,686	資本財・サービス
AEGON NV			407.44	407.44	214	28,457	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N			298.83	294.83	514	68,367	生活必需品
AKZO NOBEL			58	58	438	58,288	素材
KONINKLIJKE DSM NV			44	43.5	341	45,374	素材
WOLTERS KLUWER			69	69	299	39,762	資本財・サービス
BOSKALIS WESTMINSTER			21	21	64	8,625	資本財・サービス
ING GROEP NV			918.5	903.5	1,386	184,190	金融
KONINKLIJKE KPN NV			782.5	782.5	238	31,717	電気通信サービス
ASML HOLDING NV			86.8	87.5	1,294	171,930	情報技術
ABN AMRO GROUP NV-CVA			54	88	218	28,955	金融
VOPAK			16	16	56	7,456	エネルギー
RANDSTAD HOLDING NV			30	28.5	146	19,394	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV			23	26	209	27,869	生活必需品
GEMALTO			20	20	63	8,414	情報技術
ALTICE NV - A			89	115	80	10,737	一般消費財・サービス
ALTICE NV - B			29	21	14	1,966	一般消費財・サービス
AIRBUS SE			136	135.5	1,182	157,084	資本財・サービス
EXOR NV			—	25	128	17,099	金融
CNH INDUSTRIAL NV			243	243	263	35,016	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV			193.5	250.5	362	48,106	一般消費財・サービス
FERRARI NV			28.35	28.35	263	34,959	一般消費財・サービス
国 小 計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4,567.87 26 銘柄	4,674.05 27 銘柄	11,708	1,554,973 <1.6%>	
ユーロ (ベルギー)			百株	百株	千ユーロ	千円	
UCB SA			27.5	30	193	25,702	ヘルスケア
KBC GROEP NV			58	58	399	52,996	金融
COLRUYT SA			20	16	70	9,381	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA			17	18.5	166	22,061	金融
SOLVAY SA			17	17	200	26,562	素材
UMICORE			22.5	45	175	23,287	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV			179	178.1	1,742	231,449	生活必需品

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	
AGEAS		百株 47.9	百株 41.4	千ユーロ 170	千円 22,587	金融
PROXIMUS		35	35	99	13,280	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		12	12	69	9,280	一般消費財・サービス
国小計		株数、金額 銘柄数＜比率＞	435.9 10銘柄	451 10銘柄	3,287 436,588	<0.5%>
ユーロ（ルクセンブルグ）		百株	百株	千ユーロ	千円	
RTL GROUP		10	10	65	8,708	一般消費財・サービス
ARCELORMITTAL		423	156	400	53,256	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		—	2.7	136	18,173	ヘルスケア
SES		83.5	83.5	112	14,876	一般消費財・サービス
TENARIS SA		105.5	112.5	136	18,123	エネルギー
国小計		株数、金額 銘柄数＜比率＞	622 4銘柄	364.7 5銘柄	851 113,138	<0.1%>
ユーロ（フランス）		百株	百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA		16	16	55	7,345	一般消費財・サービス
SFR GROUP SA		23	—	—	—	その他
TOTAL SA		521.5	547.5	2,611	346,879	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		42	39.5	483	64,158	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		90.48	99.52	1,048	139,309	素材
KERING		18	17.9	672	89,362	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		132	132	956	127,081	資本財・サービス
BOUYGUES SA		46.5	50	215	28,683	資本財・サービス
BNP PARIBAS		249	260.5	1,674	222,424	金融
PEUGEOT SA		112.5	123.5	213	28,367	一般消費財・サービス
NATIXIS		229.5	229.5	153	20,378	金融
THALES SA		25.5	25.5	214	28,447	資本財・サービス
DANONE		138	138.5	989	131,389	生活必需品
CARREFOUR SA		129	128	227	30,225	生活必需品
SUEZ		74.75	88.75	138	18,399	公益事業
VIVENDI		237.41	237.41	539	71,605	一般消費財・サービス
L'OREAL		59.5	58.5	1,093	145,248	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		115	115	557	74,097	資本財・サービス
LEGRAND SA		63.67	63.17	395	52,527	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		13	13	66	8,838	生活必需品
PERNOD RICARD SA		49.17	49.17	642	85,285	生活必需品
SOCIETE BIC SA		7	7	66	8,854	資本財・サービス
EURAZEO SA		10.75	11.16	81	10,801	金融
REXEL SA		70.5	70.5	109	14,540	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA		180	180	772	102,543	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		65.5	65.6	1,607	213,539	一般消費財・サービス
ACCOR SA		40	44	185	24,642	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		39	37.5	365	48,508	情報技術
VALEO SA		56.5	56.5	343	45,585	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		46	47.5	266	35,327	一般消費財・サービス
BUREAU VERITAS SA		60.5	60.5	134	17,881	資本財・サービス
EIFFAGE		13	17	157	20,882	資本財・サービス
SODEXO SA		23	21.5	235	31,323	一般消費財・サービス
IPSEN		—	9	93	12,371	ヘルスケア
INGENICO GROUP		12	13.5	117	15,542	情報技術
ZODIAC AEROSPACE		48	48	118	15,733	資本財・サービス

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	千ユーロ	千円	
SEB SA		—	5	78	10,422	一般消費財・サービス
ESSILOR INTERNATIONAL		49	48.5	517	68,728	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA		—	0.6	77	10,342	資本財・サービス
AXA SA		455	455	1,161	154,213	金融
CHRISTIAN DIOR SE		13	—	—	—	一般消費財・サービス
LAGARDERE SCA		26.5	26.5	72	9,601	一般消費財・サービス
TECHNIP SA		25.5	—	—	—	その他
EDENRED		47.5	53.5	129	17,233	資本財・サービス
RENAULT SA		46	41	351	46,714	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		6.2	7.3	318	42,348	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		5.5	5.5	60	8,075	生活必需品
ATOS SE		21.5	21.5	265	35,278	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA		30.5	30.5	271	36,087	情報技術
WENDEL		6	6.8	95	12,679	金融
ORANGE		469	468	676	89,876	電気通信サービス
ALSTOM		36.5	36.5	126	16,782	資本財・サービス
CNP ASSURANCES		37.5	37.5	70	9,427	金融
SANOFI		273.75	263.25	2,026	269,139	ヘルスケア
VINCI SA		118.5	116.5	1,012	134,454	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		105.5	114.5	243	32,397	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		257	270	382	50,847	金融
ENGIE		341.73	428.73	634	84,270	公益事業
IMERYS SA		9	9	69	9,191	素材
EDF		55.5	127.5	144	19,134	公益事業
SAFRAN SA		74	74	669	88,874	資本財・サービス
ILIAD SA		6	6	118	15,706	電気通信サービス
ARKEMA		15.5	15.5	158	21,089	素材
ADP		7.5	7.5	119	15,817	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		40.5	40.5	76	10,192	一般消費財・サービス
SCOR SE		41	41.5	143	19,023	金融
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR		104.5	104.5	115	15,287	資本財・サービス
BOLLORE		190	190	84	11,229	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,972.41	6,174.86	27,878	3,702,606	
		65銘柄	65銘柄		<3.9%>	
ユーロ（ドイツ）		百株	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG		195.5	193.5	2,090	277,674	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		38	38	118	15,687	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		321.5	486.5	781	103,831	金融
COMMERZBANK AG		246.85	246.85	299	39,783	金融
VOLKSWAGEN AG		8	8	137	18,264	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		43.5	43	759	100,910	一般消費財・サービス
MAN SE		8.5	8.5	80	10,690	資本財・サービス
SIEMENS AG-REG		179	179.5	2,055	272,961	資本財・サービス
E.ON SE		465	517	509	67,625	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		77.5	78	660	87,773	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		42	42	168	22,440	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG		21.6	23.6	165	21,971	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		25.5	25.5	560	74,387	一般消費財・サービス

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	千ユーロ	千円	
BASF SE		216.5	213.5	1,999	265,487	素材
LINDE AG		44	—	—	—	素材
K+S AG-REG		44	44	86	11,523	素材
ALLIANZ SE-REG		106.8	106.5	2,131	283,026	金融
THYSSENKRUPP AG		85	102	236	31,394	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		42	42	477	63,449	生活必需品
RWE AG		118	119	233	31,024	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		50.5	56.5	162	21,528	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		9	9	75	10,040	資本財・サービス
BRENNTAG AG		36.5	36.5	190	25,309	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		97	96.5	584	77,640	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		27	30	165	21,953	情報技術
HOCHTIEF AG		5	5	73	9,734	資本財・サービス
SAP SE		231.42	229.92	2,192	291,127	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		38.7	36.2	695	92,404	金融
SCHAEFFLER AG		38	38	55	7,355	一般消費財・サービス
ZALANDO SE		19	26	111	14,848	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		33	35	312	41,458	素材
KION GROUP AG		—	16.5	114	15,142	資本財・サービス
COVESTRO AG		16	26	226	30,038	素材
INNOGY SE		34	34	133	17,746	公益事業
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		37	35.5	251	33,427	一般消費財・サービス
METRO AG		—	41	66	8,883	生活必需品
LINDE AG - TENDER		—	43	844	112,103	素材
BEIERSDORF AG		23	23	226	30,051	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF		15	15	65	8,725	素材
MERCK KGAA		31	31	280	37,251	ヘルスケア
ADIDAS AG		44.2	44.1	783	104,048	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		24	24	245	32,655	生活必需品
CECONOMY AG		41	—	—	—	一般消費財・サービス
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		754	758	1,122	149,092	電気通信サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		50.5	50.5	418	55,586	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		225	225	1,577	209,564	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		270	262	608	80,796	情報技術
HANNOVER RUECK SE		14	14	155	20,629	金融
DEUTSCHE POST AG-REG		231	226	900	119,595	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		—	44.5	420	55,808	金融
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER		46	—	—	—	その他
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE		50.5	55.5	150	19,960	一般消費財・サービス
LANXESS AG		22	22	139	18,477	素材
AXEL SPRINGER SE		10	12	79	10,505	一般消費財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE		82	84	308	41,004	不動産
SYMRISE AG		30	30	211	28,057	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		165	165	65	8,721	電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		12	12	87	11,618	一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD		16.5	14.5	99	13,260	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		109	109	425	56,493	不動産
国 小 計	株 数、金 額	5,266.57	5,532.67	28,179	3,742,556	
	銘柄 数 < 比 率 >	56 銘柄	57 銘柄		< 3.9% >	

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	
ユーロ（ポルトガル）		百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS		60	60	100	13,295	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		495	495	143	19,117	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		103.5	116.5	186	24,763	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数＜比率＞	658.5 3銘柄	671.5 3銘柄	430	57,176 ＜0.1％＞	
ユーロ（スペイン）		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA		1,046.27	1,046.27	906	120,362	電気通信サービス
ENDESA SA		76.5	76.5	145	19,293	公益事業
BANCO POPULAR ESPANOL		754.73	—	—	—	金融
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		1,534.12	1,555.12	1,131	150,337	金融
IBERDROLA SA		1,271.34	1,357.34	906	120,329	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		1,319.09	1,229.09	210	27,929	金融
BANKINTER SA		151	151	122	16,209	金融
REPSOL SA		257	287	442	58,775	エネルギー
GRIFOLS SA		67	67	164	21,849	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		3,438.5	3,782.5	2,157	286,542	金融
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		149	158	294	39,072	資本財・サービス
AMADEUS IT GROUP SA		100	101	616	81,864	情報技術
GAS NATURAL SDG SA		84.5	84.5	159	21,154	公益事業
MAPFRE SA		214.5	254.5	72	9,653	金融
CAIXABANK S. A		748	816	330	43,847	金融
CAIXABANK S. A-RTS		748	—	—	—	その他
ZARDOYA OTIS SA		45.5	—	—	—	資本財・サービス
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		180	152	105	14,007	資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		44.76	53.76	176	23,429	資本財・サービス
AENA SME SA		16	16	271	35,996	資本財・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		253	253	753	100,046	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		—	56	59	7,853	資本財・サービス
ENAGAS SA		54	54	132	17,531	エネルギー
RED ELECTRICA CORPORACION SA		100	100	189	25,147	公益事業
FERROVIAL SA		117	117	216	28,746	資本財・サービス
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		157	157	62	8,236	生活必需品
BANKIA SA		1,084.22	241.05	97	12,946	金融
国小計	株数、金額 銘柄数＜比率＞	14,011.03 26銘柄	12,165.63 24銘柄	9,721	1,291,165 ＜1.4％＞	
ユーロ（イタリア）		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA		217.5	217.5	41	5,543	金融
PRYSMIAN SPA		48	48	133	17,747	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		278.43	290.43	441	58,668	金融
SAIPEM SPA		1,343	134.3	46	6,207	エネルギー
MEDIOBANCA SPA		146.15	130.15	123	16,438	金融
UNICREDIT SPA		1,235.69	473.06	806	107,057	金融
TELECOM ITALIA SPA		2,582.82	2,662.82	186	24,773	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP		1,349.5	1,349.5	77	10,278	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO-RSP		210	210	55	7,418	金融
INTESA SANPAOLO		2,985.97	3,143.97	886	117,749	金融
ATLANTIA SPA		99.07	106.07	293	39,021	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		118	118	72	9,630	金融

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	
RECORDATI SPA			百株	百株	千ユーロ	千円	ヘルスケア
ENI SPA			—	26	97	12,990	エネルギー
LEONARDO SPA			598	591	813	108,003	資本財・サービス
ENEL SPA			95.25	95.25	95	12,688	公益事業
SNAM SPA			1,778.34	1,896.34	1,038	137,889	エネルギー
LUXOTTICA GROUP SPA			582	532	225	29,887	一般消費財・サービス
TERNA SPA			37	38.5	184	24,563	公益事業
EXOR SPA			354	324	167	22,311	金融
			25	—	—	—	
国 小 計	株 数、金 額	14,083.72	12,386.89	5,789	768,866		
	銘柄 数 < 比 率 >	19 銘柄	19 銘柄		<0.8%>		
ユーロ (フィンランド)			百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ			124	124	318	42,274	素材
NOKIA OYJ			1,358.5	1,389.5	584	77,691	情報技術
WARTSILA OYJ ABP			32	33.5	185	24,648	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS			131	131	171	22,721	素材
METSO OYJ			30	24	71	9,492	資本財・サービス
ELISA OYJ			35.5	32.5	110	14,645	電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS			103	103.5	461	61,278	金融
FORTUM OYJ			104.5	104.5	183	24,329	公益事業
KONE OYJ-B			78.5	78.5	341	45,361	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ			30	26.5	96	12,835	一般消費財・サービス
NESTE OYJ			29.5	29.5	149	19,824	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B			20.5	24.5	79	10,516	ヘルスケア
国 小 計	株 数、金 額	2,077	2,101.5	2,752	365,619		
	銘柄 数 < 比 率 >	12 銘柄	12 銘柄		<0.4%>		
ユーロ (オーストリア)			百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG			35.5	35.5	185	24,573	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG			66.5	66.5	242	32,267	金融
VOESTALPINE AG			28.5	28.5	139	18,554	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA			24	34	102	13,636	金融
ANDRITZ AG			16	16	74	9,852	資本財・サービス
国 小 計	株 数、金 額	170.5	180.5	744	98,884		
	銘柄 数 < 比 率 >	5 銘柄	5 銘柄		<0.1%>		
ユーロ (その他)			百株	百株	千ユーロ	千円	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS			52	52	168	22,355	生活必需品
STMICROELECTRONICS NV			153	146	275	36,540	情報技術
国 小 計	株 数、金 額	205	198	443	58,896		
	銘柄 数 < 比 率 >	2 銘柄	2 銘柄		<0.1%>		
ユ ー ロ 通 貨 計	株 数、金 額	54,940	45,373.4	93,029	12,355,299		
	銘柄 数 < 比 率 >	232 銘柄	233 銘柄		<13.0%>		
フ ァ ン ド 合 計	株 数、金 額	291,354.98	278,979.17	—	90,681,988		
	銘柄 数 < 比 率 >	1,238 銘柄	1,256 銘柄		<95.5%>		

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国投資信託証券

銘 柄	期 首	当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	額
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3.197	3.197	581	65,211
SIMON PROPERTY GROUP INC	7.187	7.137	1,132	126,936
BOSTON PROPERTIES INC	3.6	3.55	443	49,742
GGP INC	13.6	14.4	336	37,756
VORNADO REALTY TRUST	3.827	3.827	294	32,988
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	2.75	466	52,309
EQUITY RESIDENTIAL	8.5	8.5	567	63,564
EQUINIX INC	1.608	1.808	846	94,875
AMERICAN TOWER CORP	9.75	9.75	1,426	159,830
HOST HOTELS & RESORTS INC	17.293	17.293	340	38,114
KIMCO REALTY CORP	10	10	184	20,695
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	12	147	16,538
VENTAS INC	7.9	8.3	531	59,586
WEYERHAEUSER CO	17.614	16.964	600	67,231
AGNC INVESTMENT CORP	7.8	9	180	20,239
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6.9	6.9	125	14,102
CROWN CASTLE INTL CORP	7.75	9.25	1,043	116,975
IRON MOUNTAIN INC	5.61	5.61	227	25,470
VEREIT INC	22.3	22.3	175	19,614
PROLOGIS INC	12.262	12.262	810	90,859
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.7	2.1	266	29,876
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	2.15	196	22,064
DUKE REALTY CORP	8	8	229	25,681
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.48	1.48	366	41,073
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1.6	1.6	211	23,682
WELLTOWER INC	8.3	8.4	565	63,325
HCP INC	10.7	10.7	287	32,251
LIBERTY PROPERTY TRUST	3.3	3.3	147	16,498
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.7	2.6	265	29,788
MACERICH CO/THE	3	2.7	173	19,431
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23.2	26.6	313	35,080
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	3.4	140	15,760
REALTY INCOME CORP	6	6.45	357	40,089
PUBLIC STORAGE	3.4	3.6	756	84,814
REGENCY CENTERS CORP	2.3	3.5	238	26,667
SL GREEN REALTY CORP	2.25	2.25	230	25,773
UDR INC	6.3	6.3	247	27,784
DIGITAL REALTY TRUST INC	3.7	4.75	555	62,266
EXTRA SPACE STORAGE INC	2.75	3	255	28,592
ア メ リ カ ・ ド ル 通 貨 計	□ 数、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	258.378 36 銘柄	287.678 39 銘柄	16,270 <1.9%>
(カナダ)				
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1.5	1.5	43	3,809
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3	3	62	5,482
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3.3	3.9	96	8,444
カ ナ ダ ・ ド ル 通 貨 計	□ 数、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	7.8 3 銘柄	8.4 3 銘柄	203 <0.0%>

銘 柄	期 首 □ 数	当 期 □ 数	期 末 評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)				
LENDLEASE GROUP	—	13.3	214	18,173
TRANSURBAN GROUP	—	47.8	601	51,034
SYDNEY AIRPORT	—	25.1	188	15,976
APA GROUP	—	26.7	247	21,028
SCENTRE GROUP	121.922	124.222	525	44,595
DEXUS	23.95	23.95	244	20,753
GPT GROUP	40.06	44.06	235	20,005
MIRVAC GROUP	93.4	84.4	205	17,477
STOCKLAND	57	57	266	22,639
WESTFIELD CORP	45.496	45.496	380	32,280
GOODMAN GROUP	41.7	41.7	363	30,825
VICINITY CENTRES	74.873	76.973	213	18,160
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	498.401 8 銘柄	610.701 12 銘柄	3,687 <0.3%>
(香港)				
LINK REIT	52	52	3,658	52,495
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	64.5	462	6,636
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	—	87	860	12,347
香 港 ド ル 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	52 1 銘柄	203.5 3 銘柄	4,981 <0.1%>
(シンガポール)				
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	60.1	111	9,299
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	48	57.4	150	12,558
CAPITALAND MALL TRUST	63.2	63.2	130	10,830
SUNTEC REIT	53	53	106	8,818
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	164.2 3 銘柄	233.7 4 銘柄	498 <0.0%>
(イギリス)				
LAND SECURITIES GROUP PLC	18.2	17.062	158	23,853
SEGRO PLC	19.95	23.75	130	19,619
HAMMERSON PLC	17.4	19.2	99	14,907
BRITISH LAND CO PLC	22.1	22.1	137	20,731
INTU PROPERTIES PLC	21.1	21.1	41	6,175
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	98.75 5 銘柄	103.212 5 銘柄	567 <0.1%>
ユーロ (フランス)				
UNIBAIL-RODAMCO SE	2.36	2.35	510	67,851
ICADE	0.75	0.9	70	9,421
GECINA SA	0.95	1.15	160	21,260
KLEPIERRE	5.2	5.2	179	23,902
FONCIERE DES REGIONS	0.75	0.75	66	8,894
国 小 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	10.01 5 銘柄	10.35 5 銘柄	988 <0.1%>
合 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,089.539 61 銘柄	1,457.541 71 銘柄	— <2.6%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

(3) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

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

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

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

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

- (注 1) 評価額の単位未満は切捨て。
- (注 2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝112.05円、1カナダ・ドル＝87.10円、1オーストラリア・ドル＝84.87円、1香港ドル＝14.35円、1シンガポール・ドル＝83.19円、1ニュージーランド・ドル＝76.68円、1イギリス・ポンド＝150.33円、1イスラエル・シェケル＝31.98円、1スイス・フラン＝113.83円、1デンマーク・クローネ＝17.84円、1ノルウェー・クローネ＝13.58円、1スウェーデン・クローネ＝13.38円、1ユーロ＝132.81円です。
- (注 3) 当期末における外貨建純資産 (94,407,006千円) の投資信託財産総額 (95,001,876千円) に対する比率は、99.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

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

- *期首における元本額は40,539,431,105円、当期中における追加設定元本額は5,901,304,959円、同解約元本額は6,706,629,096円です。
- *当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国株式インデックスV A565,889,975円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）18,626,936円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）281,422,814円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）32,623,332円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）908,478,453円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）399,976,869円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）900,220,105円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）305,036,599円、D－I’s 外国株式インデックス992,761円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 175,432円、iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）391,225,801円、iFree 8資産バランス291,084,495円、DCダイワ外国株式インデックス24,052,269,212円、ダイワ・ライフ・バランス30500,509,712円、ダイワ・ライフ・バランス50709,804,567円、ダイワ・ライフ・バランス70564,304,287円、大和DC海外株式インデックスファンド1,438,818,935円、DCダイワ・ターゲットイヤー20205,379,290円、DCダイワ・ターゲットイヤー203014,469,810円、DCダイワ・ターゲットイヤー20403,513,286円、ダイワ世界分散バランスファンド15VA81,383円、ダイワ世界分散バランスファンド20VA162,594円、ダイワ世界分散バランスファンド25VA2,143,628円、ダイワ世界分散バランスファンド30VA8,975,878円、ダイワ世界バランスファンド40VA506,282,561円、ダイワ世界バランスファンド60VA392,714,678円、ダイワ・バランスファンド35VA3,809,894,746円、ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）179,797,597円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式498,683,806円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド44,190,165円、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）464,730円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス2,755,474,027円、ダイワライフスタイル2520,423,108円、ダイワライフスタイル5071,323,850円、ダイワライフスタイル7558,671,546円です。
- *当期末の計算口数当りの純資産額は23,891円です。

■損益の状況

当期 自 2016年12月1日 至 2017年11月30日

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

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

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

ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)

運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2018年6月15日)

★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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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

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、「ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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

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（D B I）総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率	純資産 総 額
		税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6 月15日)	10,065	0	0.7	521.587	0.7	99.4	—	24
2 期末 (2018年 6 月15日)	10,124	0	0.6	525.468	0.7	99.4	—	279

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

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

(注 3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注 4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数です。

基準価額・騰落率

期首：10,065円

期末：10,124円

騰落率：0.6%

基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (D B I) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2017年 6 月15日	円	%		%	%	%
	10,065	—	521.587	—	99.4	—
6 月末	10,034	△ 0.3	519.979	△ 0.3	99.5	—
7 月末	10,035	△ 0.3	520.066	△ 0.3	98.7	—
8 月末	10,087	0.2	522.848	0.2	99.6	—
9 月末	10,048	△ 0.2	520.909	△ 0.1	99.1	—
10 月末	10,047	△ 0.2	520.920	△ 0.1	99.3	—
11 月末	10,071	0.1	522.295	0.1	99.3	—
12 月末	10,077	0.1	522.656	0.2	99.4	—
2018年 1 月末	10,059	△ 0.1	521.766	0.0	99.4	—
2 月末	10,097	0.3	523.788	0.4	99.4	—
3 月末	10,111	0.5	524.618	0.6	99.3	—
4 月末	10,102	0.4	524.225	0.5	99.6	—
5 月末	10,123	0.6	525.397	0.7	99.1	—
(期末)2018年 6 月15日	10,124	0.6	525.468	0.7	99.4	—

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■国内債券市況

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

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

今後も、ベンチマーク（ダイワ・ボンド・インデックス（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

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

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

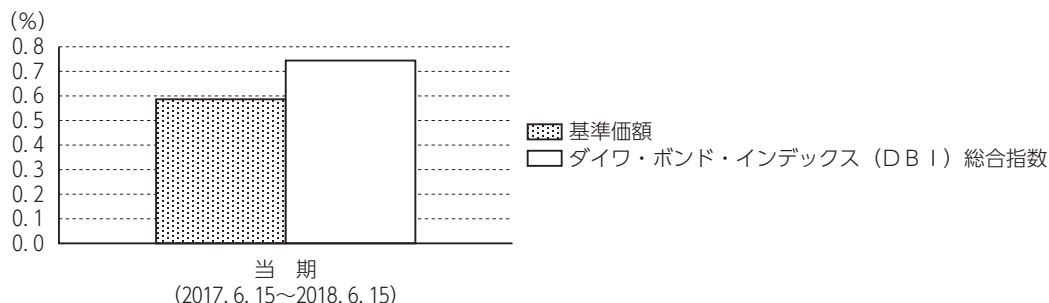
当ファンドの騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行ないました。期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッドの変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行ないました。

ベンチマークとの差異について

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益やポートフォリオの利回り水準等を勘案し、収益分配は行ないませんでした。

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（1万口当たり）

項 目		当 期
		2017年6月16日 ～2018年6月15日
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	124

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 6. 16～2018. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	15円	0. 146%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10, 076円です。
(投 信 会 社)	(8)	(0. 081)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(5)	(0. 054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(1)	(0. 011)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 006	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 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	15	0. 151	

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

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況
(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日本債券 インデックス マザーファンド	181,753	254,555	16	22

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等
(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況
当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況
(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

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

(注) 平均保有割合0.1%
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファン
ドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率
当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■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

期首保有額	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

(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	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日本債券インデックス マザーファンド	17,293	199,030	279,060

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成
2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本債券インデックス マザーファンド	279,060	99.9
コール・ローン等、その他	346	0.1
投資信託財産総額	279,406	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況
2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	279,406,720円
コール・ローン等	346,485
日本債券インデックス マザーファンド（評価額）	279,060,235
(B) 負債	80,160
未払信託報酬	77,364
その他未払費用	2,796
(C) 純資産総額（A－B）	279,326,560
元本	275,900,547
次期繰越損益金	3,426,013
(D) 受益権総口数	275,900,547口
1万口当り基準価額（C／D）	10,124円

*期首における元本額は23,931,206円、当期中における追加設定元本額は
251,969,341円、同解約元本額は0円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は10,124円です。

■損益の状況

当期 自 2017年 6月16日 至 2018年 6月15日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	457, 069円
売買益	457, 069
(B) 信託報酬等	△ 98, 229
(C) 当期損益金 (A + B)	358, 840
(D) 前期繰越損益金	87, 489
(E) 追加信託差損益金	2, 979, 684
(配当等相当額)	(1, 288, 693)
(売買損益相当額)	(1, 690, 991)
(F) 合計 (C + D + E)	3, 426, 013
次期繰越損益金 (F)	3, 426, 013
追加信託差損益金	2, 979, 684
(配当等相当額)	(1, 288, 693)
(売買損益相当額)	(1, 690, 991)
分配準備積立金	621, 868
繰越損益金	△ 175, 539

- (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	534, 379円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	2, 804, 145
(d) 分配準備積立金	87, 489
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	3, 426, 013
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	3, 426, 013
(h) 受益権総口数	275, 900, 547口

日本債券インデックスマザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用））が投資対象としている「日本債券インデックスマザーファンド」の決算日（2017年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15日）現在における日本債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を195～203ページに併せて掲載いたしました。

■日本債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

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

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

■組入資産明細表

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

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

作 成 期 区 分	2018年6月15日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5 年以上	2 年以上	2 年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	57,516,000	62,694,390	84.2	—	56.5	20.3	7.3
地方債証券	4,250,000	4,460,002	6.0	—	2.7	2.6	0.6
特殊債券（除く金融債券）	3,100,000	3,240,168	4.4	—	1.9	2.5	—
金融債券	100,000	98,205	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	3,500,000	3,606,957	4.8	—	1.8	1.8	1.2
合 計	68,466,000	74,099,724	99.5	—	63.1	27.3	9.1

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

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

2018年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
国債証券	378 2年国債	0.1000	100,000	100,258	2019/07/15
	380 2年国債	0.1000	330,000	330,986	2019/09/15
	120 5年国債	0.2000	180,000	180,770	2019/09/20
	121 5年国債	0.1000	550,000	551,661	2019/09/20
	303 10年国債	1.4000	60,000	61,164	2019/09/20
	304 10年国債	1.3000	110,000	111,995	2019/09/20
	43 20年国債	2.9000	100,000	103,829	2019/09/20
	382 2年国債	0.1000	250,000	250,847	2019/11/15
	383 2年国債	0.1000	530,000	531,902	2019/12/15
	122 5年国債	0.1000	630,000	632,230	2019/12/20
	305 10年国債	1.3000	500,000	510,830	2019/12/20
	385 2年国債	0.1000	500,000	502,000	2020/02/15
	123 5年国債	0.1000	730,000	732,949	2020/03/20
	306 10年国債	1.4000	255,000	261,877	2020/03/20
	307 10年国債	1.3000	400,000	410,088	2020/03/20
	44 20年国債	2.5000	85,000	88,936	2020/03/20
	45 20年国債	2.4000	78,000	81,474	2020/03/20
	124 5年国債	0.1000	980,000	984,527	2020/06/20
	308 10年国債	1.3000	200,000	205,770	2020/06/20
	309 10年国債	1.1000	90,000	92,234	2020/06/20
	46 20年国債	2.2000	73,000	76,436	2020/06/22
	125 5年国債	0.1000	860,000	864,472	2020/09/20
	310 10年国債	1.0000	130,000	133,341	2020/09/20
	311 10年国債	0.8000	150,000	153,175	2020/09/20
	47 20年国債	2.2000	89,000	93,700	2020/09/21
	126 5年国債	0.1000	890,000	895,144	2020/12/20
	312 10年国債	1.2000	395,000	408,264	2020/12/20
	48 20年国債	2.5000	54,000	57,575	2020/12/21
	127 5年国債	0.1000	780,000	784,953	2021/03/20
	313 10年国債	1.3000	200,000	207,902	2021/03/20
	314 10年国債	1.1000	260,000	268,834	2021/03/20
	49 20年国債	2.1000	64,000	67,960	2021/03/22
	50 20年国債	1.9000	107,000	113,029	2021/03/22
	128 5年国債	0.1000	755,000	760,118	2021/06/20
	315 10年国債	1.2000	221,000	229,833	2021/06/20
	316 10年国債	1.1000	250,000	259,237	2021/06/20
	51 20年国債	2.0000	82,000	87,274	2021/06/21
	129 5年国債	0.1000	880,000	886,327	2021/09/20
	317 10年国債	1.1000	214,000	222,536	2021/09/20
	318 10年国債	1.0000	200,000	207,324	2021/09/20
	52 20年国債	2.1000	52,000	55,787	2021/09/21
	130 5年国債	0.1000	980,000	987,585	2021/12/20
	319 10年国債	1.1000	100,000	104,278	2021/12/20
	320 10年国債	1.0000	230,000	239,027	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	66,000	71,147	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	65,000	70,298	2021/12/20
	131 5年国債	0.1000	920,000	927,626	2022/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

2018年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	321 10年国債	1.0000	175,355	182,355	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	130,000	134,973	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	140,000	151,169	2022/03/21
	132 5年国債	0.1000	580,000	585,133	2022/06/20
	324 10年国債	0.8000	410,000	425,092	2022/06/20
	133 5年国債	0.1000	250,000	252,352	2022/09/20
	325 10年国債	0.8000	310,000	322,133	2022/09/20
	58 20年国債	1.9000	200,000	217,194	2022/09/20
	134 5年国債	0.1000	510,000	515,079	2022/12/20
	326 10年国債	0.7000	30,000	31,107	2022/12/20
	327 10年国債	0.8000	450,000	468,652	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	48,689	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,683	2022/12/20
	135 5年国債	0.1000	600,000	606,162	2023/03/20
	328 10年国債	0.6000	550,000	568,656	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	105,304	2023/03/20
	329 10年国債	0.8000	500,000	522,765	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	99,325	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	142,460	2023/06/20
	330 10年国債	0.8000	312,000	326,838	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	365,000	378,501	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	99,486	2023/09/20
	332 10年国債	0.6000	310,000	321,835	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	194,272	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	135,000	149,119	2023/12/20
	333 10年国債	0.6000	640,000	665,344	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	61,294	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	135,813	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	123,860	2024/03/20
	334 10年国債	0.6000	600,000	624,618	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	95,420	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	142,197	2024/06/20
	335 10年国債	0.5000	780,000	808,197	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	175,000	198,929	2024/09/20
	336 10年国債	0.5000	275,000	285,243	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	300,000	307,254	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	136,236	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	83,354	2024/12/20
	338 10年国債	0.4000	490,000	505,454	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	91,748	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	57,797	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	148,209	2025/03/20
	339 10年国債	0.4000	380,000	392,156	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	69,386	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	57,225	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	61,032	2025/06/20
	340 10年国債	0.4000	770,000	795,525	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	76,000	87,348	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	100,624	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	520,000	533,712	2025/12/20

2018年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	83 20年国債	2.1000	93,000	108,025	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	780,000	788,798	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	67,679	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	94,596	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	64,606	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	800,000	808,664	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	118,745	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	91,994	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	640,000	646,617	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	23,682	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	60,000	71,542	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	590,000	595,776	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	365,843	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	750,000	756,892	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	117,558	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	153,964	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	250,000	252,137	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	60,329	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	65,371	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	600,000	604,992	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	48,102	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	120,000	143,196	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	650,000	654,933	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	250,000	299,340	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	650,000	654,420	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	187,709	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	75,000	92,286	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	99,662	2028/04/20
	102 20年国債	2.4000	80,000	98,814	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	70,000	85,765	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	12,052	2028/06/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	152,359	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	182,911	2028/09/20
	107 20年国債	2.1000	27,000	32,750	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	177,000	211,003	2028/12/20
	109 20年国債	1.9000	35,000	41,813	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	130,000	158,081	2029/03/20
	111 20年国債	2.2000	130,000	159,978	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	170,000	207,349	2029/06/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	20,843	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	250,000	305,830	2029/09/20
	114 20年国債	2.1000	130,000	159,576	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	223,000	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	30,336	2030/02/20
	116 20年国債	2.2000	140,000	173,951	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	215,000	264,643	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	37,686	2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	116,136	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	111,490	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	210,000	246,781	2030/06/20

日本債券インデックスマザーファンド

2018年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	121 20年国債	1.9000	135,000	163,829	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	160,000	192,238	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	48,163	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	140,000	173,727	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	193,000	237,123	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	85,000	106,872	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	135,465	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	165,000	201,133	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	35,230	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	119,000	145,379	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	200,000	241,788	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	169,586	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	80,000	95,868	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	31,004	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	120,000	144,051	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	210,000	254,858	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	80,000	97,263	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	110,618	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	185,000	219,961	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	70,690	2032/05/20
	137 20年国債	1.7000	70,000	84,247	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	87,000	102,338	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	185,000	220,135	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	335,000	403,815	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	32,966	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	50,097	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	170,000	205,225	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	200,000	244,422	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	50,478	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	250,693	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	120,000	141,543	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	48,423	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	320,000	387,385	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	76,257	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	230,000	278,603	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	94,311	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	250,000	299,487	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	108,310	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	300,000	354,951	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	100,000	133,905	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	252,000	298,410	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	100,000	134,207	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	320,000	373,984	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	80,000	106,339	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	300,000	341,124	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	105,270	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	350,000	398,023	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	75,140	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	380,000	438,292	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	60,000	81,192	2035/09/20

2018年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	154 20年国債	1.2000	330,000	375,038	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	79,300	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	240,000	264,640	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	70,000	95,155	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	330,000	329,726	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	60,000	81,711	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	360,000	346,449	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	125,512	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	100,000	101,270	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	199,452	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	230,000	236,499	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	242,800	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	220,000	229,708	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	290,000	297,093	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	205,770	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	300,000	306,615	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	290,000	295,942	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	233,857	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	310,000	310,000	2038/03/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	272,404	2038/09/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	296,406	2039/03/20
	31 30年国債	2.2000	180,000	239,718	2039/09/20
	32 30年国債	2.3000	235,000	318,927	2040/03/20
	33 30年国債	2.0000	261,000	339,070	2040/09/20
	34 30年国債	2.2000	233,000	313,280	2041/03/20
	35 30年国債	2.0000	270,000	352,177	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	270,000	352,989	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	290,000	373,786	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	170,000	215,826	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	172,000	222,552	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	140,000	178,019	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	170,000	212,306	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	146,000	182,434	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	160,000	200,041	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	165,000	206,405	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	200,000	240,614	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	180,000	216,595	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	190,000	233,612	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	190,000	224,293	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	93,000	109,787	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	215,000	221,280	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	210,000	189,222	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	235,000	223,383	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	195,000	190,138	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	218,000	223,753	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	200,000	205,068	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	210,000	215,098	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	200,000	204,640	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	101,553	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	220,000	224,862	2048/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

2018年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	2 40年国債	2.2000	116,000	162,917	2049/03/20
	3 40年国債	2.2000	74,000	104,464	2050/03/20
	4 40年国債	2.2000	107,000	151,581	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	170,296	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	140,220	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	154,496	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	272,287	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	189,002	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	375,000	381,577	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	60,000	58,846	2058/03/20
種 別 小 計	銘 柄 数	257銘柄			
	金 額		57,516,000	62,694,390	
地方債証券	76 共同発行地方	1.4000	50,000	50,769	2019/07/25
	21-6 千葉県公債	1.4100	100,000	101,787	2019/09/25
	81 共同発行地方	1.3200	100,000	101,994	2019/12/25
	21-3 広島市公債	1.3400	100,000	102,025	2019/12/25
	21-5 京都市公債	1.4500	100,000	102,445	2020/02/25
	471 名古屋市債	1.2700	100,000	102,527	2020/06/19
	688 東京都公債	0.9400	100,000	102,110	2020/09/18
	90 共同発行地方	1.1200	100,000	102,529	2020/09/25
	22-1 岡山県公債	1.0500	100,000	102,560	2020/11/30
	22-5 京都府公債	1.2600	100,000	103,151	2020/12/21
	699 東京都公債	1.0200	100,000	103,238	2021/09/17
	23-2 島根県公債	1.0300	100,000	103,452	2021/11/25
	108 共同発行地方	1.0100	100,000	103,699	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	103,670	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	103,211	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	103,549	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	103,363	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	103,183	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	103,370	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	103,332	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	103,123	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	103,163	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	103,345	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	102,053	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	104,001	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	206,907	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	103,390	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	102,783	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,329	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	206,083	2025/04/16
	751 東京都公債	0.3700	100,000	102,020	2025/12/19
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	199,813	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,312	2027/06/23
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	121,577	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	118,713	2028/12/20
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	120,080	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	116,754	2033/12/09

2018年 6月15日現在						
区 分		銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		16 千葉県20年	1.5550 %	100,000 千円	116,743 千円	2034/04/14
		31 神奈川県20年	1.0020	100,000	108,101	2035/12/20
		4 埼玉県30年	1.3270	100,000	112,731	2045/12/20
種 別 小 計	銘 柄 数	40銘柄				
	金 額			4,250,000	4,460,002	
特殊債券（除く金融債券）		14政保地方公共6	0.1990	100,000	100,417	2020/06/18
		61 道路機構	1.2400	100,000	102,448	2020/06/19
		13 地方公共団体	1.2780	100,000	102,548	2020/06/26
		110 政保道路機構	1.3000	100,000	102,665	2020/06/30
		3 公営企業15年	2.2000	100,000	106,456	2021/05/21
		29 地方公共団体	1.0250	100,000	103,304	2021/10/28
		81 道路機構	1.0300	100,000	103,456	2021/12/20
		33 地方公共団体	1.0350	100,000	103,659	2022/02/28
		25 日本政策金融	0.9970	100,000	103,679	2022/05/10
		168 政保道路機構	0.8390	100,000	103,478	2022/07/29
		39政保地方公共団	0.8010	100,000	103,368	2022/08/15
		173 政保道路機構	0.8190	100,000	103,547	2022/09/30
		175 政保道路機構	0.7910	100,000	103,499	2022/10/31
		25 政保日本政策	0.8150	100,000	103,833	2023/02/24
		19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	103,172	2023/03/15
		186 政保道路機構	0.6680	100,000	103,170	2023/03/17
		48 地方公共団体	0.8130	100,000	103,680	2023/05/26
		190 政保道路機構	0.6050	100,000	103,009	2023/05/31
		51 地方公共団体	0.8410	100,000	103,965	2023/08/28
		65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,694	2024/10/28
		236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,889	2025/01/31
		71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,295	2025/04/28
		261 政保道路機構	0.3810	200,000	204,965	2025/11/28
		F143地方公共団体	1.3510	100,000	110,546	2027/08/25
		1 地方公共団15年	1.3340	100,000	110,747	2028/01/28
		86 政保道路機構	2.0000	100,000	119,982	2029/07/31
		31 地方公共団20	1.7440	100,000	118,917	2033/09/28
		223 政保道路機構	1.4270	100,000	116,248	2034/07/31
		284 政保道路機構	0.1490	200,000	188,520	2036/07/31
種 別 小 計	銘 柄 数	29銘柄				
	金 額			3,100,000	3,240,168	
金融債券		19 利付商工債	0.1000	100,000	98,205	2026/09/18
種 別 小 計	銘 柄 数	1銘柄				
	金 額			100,000	98,205	
普通社債券		14 武田薬品	0.5400	100,000	100,502	2019/07/19
		20 三井住友 BK 劣	2.2100	100,000	102,388	2019/07/24
		164 オリックス	1.1460	100,000	101,250	2019/08/07
		24 太平洋セメント	0.3900	100,000	100,310	2019/09/11
		423 九州電力	0.9590	100,000	101,207	2019/09/25
		62東日本旅客鉄道	1.4240	100,000	101,786	2019/09/27
		8ドイツ銀行 AG ロンドン	0.4700	100,000	99,705	2019/11/14

日本債券インデックスマザーファンド

2018年 6月15日現在						
区 分		銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
			%	千円	千円	
		29 東日本高速道	0.1800	100,000	100,268	2020/03/19
		260 北陸電力	2.3300	100,000	104,505	2020/05/25
		9 AUST・NZ 銀行	0.3430	100,000	100,401	2020/07/24
		20 東京三菱銀行	2.5700	100,000	105,395	2020/07/27
		15 トヨタファイナンス	1.8000	100,000	103,866	2020/08/21
		17 シティグループ・インク	2.0400	100,000	104,287	2020/09/16
		72東日本旅客鉄道	1.2800	100,000	103,111	2020/12/22
		44 野村ホールディング	0.7230	100,000	101,543	2021/02/25
		2 イオンFS	0.5720	100,000	100,532	2021/03/18
		9三菱 UFJ 信託 BK 劣	1.6800	100,000	104,462	2021/04/28
		11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,699	2022/06/20
		11三菱 UFJ 信託 BK	1.3600	100,000	104,741	2022/06/27
		372 中国電力	1.2040	100,000	104,681	2022/08/25
		4 JX ホールディングス	1.1450	100,000	104,511	2022/12/14
		30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	103,034	2022/12/14
		175 オリックス	1.0640	100,000	104,360	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	103,433	2023/12/20
		1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	103,400	2024/06/26
		5 野村不動産 HD	0.9240	100,000	103,748	2025/05/30
		4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	103,671	2025/12/18
		20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,283	2026/08/21
		17 パナソニック	0.4700	100,000	101,101	2026/09/18
		509 関西電力	0.4700	100,000	100,654	2027/05/25
		12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	100,279	2027/06/11
		15 デンソー	0.2450	100,000	99,852	2027/06/18
		78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	99,935	2027/07/23
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	119,634	2029/01/29
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	113,408	2045/01/27
種 別 小 計	銘 柄 数	35銘柄				
	金 額			3,500,000	3,606,957	
合 計	銘 柄 数	362銘柄				
	金 額			68,466,000	74,099,724	

(注) 単位未満は切捨て。

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第18期 (決算日 2017年11月30日)

(計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和投資信託

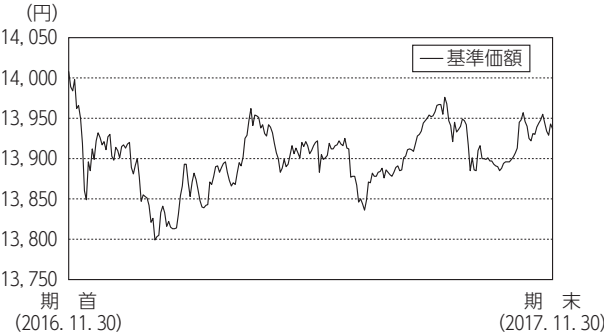
Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

日本債券インデックスマザーファンド

■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) 2016年11月30日	14,008	—	524.807	—	98.5	—	—	—
12月末	13,930	△ 0.6	521.909	△ 0.6	99.3	—	—	—
2017年 1月末	13,851	△ 1.1	518.958	△ 1.1	99.3	—	—	—
2月末	13,893	△ 0.8	520.564	△ 0.8	99.2	—	—	—
3月末	13,873	△ 1.0	519.891	△ 0.9	98.1	—	—	—
4月末	13,942	△ 0.5	522.469	△ 0.4	99.6	—	—	—
5月末	13,916	△ 0.7	521.440	△ 0.6	99.0	—	—	—
6月末	13,877	△ 0.9	519.979	△ 0.9	99.6	—	—	—
7月末	13,880	△ 0.9	520.066	△ 0.9	98.7	—	—	—
8月末	13,953	△ 0.4	522.848	△ 0.4	99.7	—	—	—
9月末	13,901	△ 0.8	520.909	△ 0.7	99.1	—	—	—
10月末	13,902	△ 0.8	520.920	△ 0.7	99.3	—	—	—
(期末) 2017年11月30日	13,937	△ 0.5	522.295	△ 0.5	99.4	—	—	—

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について
【基準価額・騰落率】
期首：14,008円 期末：13,937円 騰落率：△0.5%
【基準価額の主な変動要因】
債券からの利息収入を得た一方、金利水準の上昇による債券価格の下落により、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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

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

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

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

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

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

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

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

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

■ 主要な売買銘柄

公 社 債

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

当 期		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
131 5年国債 0. 1% 2022/3/20	1, 010, 475	368 2年国債 0. 1% 2018/9/15	631, 617
346 10年国債 0. 1% 2027/3/20	844, 805	366 2年国債 0. 1% 2018/7/15	441, 690
130 5年国債 0. 1% 2021/12/20	707, 309	371 2年国債 0. 1% 2018/12/15	381, 227
324 10年国債 0. 8% 2022/6/20	586, 156	127 5年国債 0. 1% 2021/3/20	262, 350
371 2年国債 0. 1% 2018/12/15	583, 765	341 10年国債 0. 3% 2025/12/20	256, 429
347 10年国債 0. 1% 2027/6/20	572, 679	131 5年国債 0. 1% 2022/3/20	252, 170
345 10年国債 0. 1% 2026/12/20	571, 739	293 10年国債 1. 8% 2018/6/20	242, 905
129 5年国債 0. 1% 2021/9/20	504, 938	160 20年国債 0. 7% 2037/3/20	231, 899
121 5年国債 0. 1% 2019/9/20	502, 884	64 政保道路機構 1. 6% 2018/8/29	222, 882
160 20年国債 0. 7% 2037/3/20	454, 931	332 10年国債 0. 6% 2023/12/20	209, 246

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

日本債券インデックスマザーファンド

■組入資産明細表

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

作成期	当			期				末
区分	額面金額	評価額	組入比率	うちB格以下組入率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国債証券	52,073,000	56,883,147	83.5	—	54.9	19.7	8.9	
地方債証券	4,250,000	4,405,150	6.5	—	2.9	2.7	0.8	
特殊債券（除く金融債券）	3,000,000	3,112,472	4.6	—	2.4	2.0	0.1	
金融債券	100,000	98,784	0.1	—	0.1	—	—	
普通社債券	3,100,000	3,212,890	4.7	—	1.2	2.0	1.5	
合計	62,523,000	67,712,446	99.4	—	61.6	26.3	11.4	

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

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

当		期	末		
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	371 2年国債	0.1000	200,000	200,546	2018/12/15
	116 5年国債	0.2000	500,000	501,880	2018/12/20
	297 10年国債	1.4000	70,000	71,141	2018/12/20
	298 10年国債	1.3000	125,000	126,907	2018/12/20
	372 2年国債	0.1000	130,000	130,384	2019/01/15
	373 2年国債	0.1000	300,000	300,954	2019/02/15
	374 2年国債	0.1000	320,000	321,084	2019/03/15
	117 5年国債	0.2000	730,000	733,299	2019/03/20
	299 10年国債	1.3000	250,000	254,685	2019/03/20
	300 10年国債	1.5000	286,000	292,100	2019/03/20
	41 20年国債	1.5000	136,000	138,909	2019/03/20
	42 20年国債	2.6000	87,000	90,092	2019/03/20
	375 2年国債	0.1000	60,000	60,216	2019/04/15
	376 2年国債	0.1000	250,000	250,957	2019/05/15
	377 2年国債	0.1000	150,000	150,609	2019/06/15
	118 5年国債	0.2000	270,000	271,460	2019/06/20
	119 5年国債	0.1000	480,000	481,852	2019/06/20
	301 10年国債	1.5000	120,000	123,060	2019/06/20
	302 10年国債	1.4000	240,000	245,750	2019/06/20
	380 2年国債	0.1000	330,000	331,560	2019/09/15
	120 5年国債	0.2000	180,000	181,132	2019/09/20
	121 5年国債	0.1000	550,000	552,469	2019/09/20
	303 10年国債	1.4000	60,000	61,673	2019/09/20
	304 10年国債	1.3000	110,000	112,869	2019/09/20
	43 20年国債	2.9000	100,000	105,488	2019/09/20
	122 5年国債	0.1000	630,000	633,162	2019/12/20
	305 10年国債	1.3000	500,000	514,810	2019/12/20
	123 5年国債	0.1000	580,000	583,265	2020/03/20
	306 10年国債	1.4000	255,000	264,021	2020/03/20
	307 10年国債	1.3000	400,000	413,232	2020/03/20

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	末	
				評 価 額	償還年月日
	44 20年国債	2.5000 %	85,000 千円	90,156 千円	2020/03/20
	45 20年国債	2.4000	78,000	82,552	2020/03/20
	124 5年国債	0.1000	550,000	553,366	2020/06/20
	308 10年国債	1.3000	200,000	207,322	2020/06/20
	309 10年国債	1.1000	90,000	92,835	2020/06/20
	46 20年国債	2.2000	73,000	77,357	2020/06/22
	125 5年国債	0.1000	640,000	644,396	2020/09/20
	310 10年国債	1.0000	130,000	134,119	2020/09/20
	311 10年国債	0.8000	150,000	153,912	2020/09/20
	47 20年国債	2.2000	89,000	94,821	2020/09/21
	126 5年国債	0.1000	750,000	755,385	2020/12/20
	312 10年国債	1.2000	395,000	411,052	2020/12/20
	48 20年国債	2.5000	54,000	58,352	2020/12/21
	127 5年国債	0.1000	680,000	685,276	2021/03/20
	313 10年国債	1.3000	200,000	209,450	2021/03/20
	314 10年国債	1.1000	260,000	270,566	2021/03/20
	49 20年国債	2.1000	64,000	68,735	2021/03/22
	50 20年国債	1.9000	107,000	114,208	2021/03/22
	128 5年国債	0.1000	605,000	609,948	2021/06/20
	315 10年国債	1.2000	221,000	231,417	2021/06/20
	316 10年国債	1.1000	250,000	260,895	2021/06/20
	51 20年国債	2.0000	82,000	88,204	2021/06/21
	129 5年国債	0.1000	830,000	837,279	2021/09/20
	317 10年国債	1.1000	214,000	223,993	2021/09/20
	318 10年国債	1.0000	200,000	208,578	2021/09/20
	52 20年国債	2.1000	52,000	56,414	2021/09/21
	130 5年国債	0.1000	700,000	706,538	2021/12/20
	319 10年国債	1.1000	100,000	104,957	2021/12/20
	320 10年国債	1.0000	230,000	240,467	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	66,000	71,953	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	65,000	71,127	2021/12/20
	131 5年国債	0.1000	750,000	757,275	2022/03/20
	321 10年国債	1.0000	175,000	183,491	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	130,000	135,747	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	140,000	152,807	2022/03/21
	132 5年国債	0.1000	310,000	313,112	2022/06/20
	324 10年国債	0.8000	410,000	427,129	2022/06/20
	56 20年国債	2.0000	70,000	76,759	2022/06/20
	133 5年国債	0.1000	200,000	202,120	2022/09/20
	325 10年国債	0.8000	310,000	323,596	2022/09/20
	327 10年国債	0.8000	300,000	313,764	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	49,118	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,763	2022/12/20
	328 10年国債	0.6000	330,000	342,282	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	105,878	2023/03/20
	329 10年国債	0.8000	355,000	372,700	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	99,765	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	143,765	2023/06/20
	330 10年国債	0.8000	262,000	275,582	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	265,000	275,650	2023/09/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	64 20年国債	1.9000 %	90,000 千円	100,431 千円	2023/09/20
	332 10年国債	0.6000	310,000	322,899	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	196,101	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	135,000	150,458	2023/12/20
	333 10年国債	0.6000	540,000	563,214	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	61,884	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	137,296	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	125,160	2024/03/20
	334 10年国債	0.6000	600,000	626,622	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	96,505	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	143,696	2024/06/20
	335 10年国債	0.5000	630,000	654,733	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	175,000	200,924	2024/09/20
	336 10年国債	0.5000	175,000	182,124	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	300,000	307,857	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	137,534	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	84,183	2024/12/20
	338 10年国債	0.4000	390,000	403,283	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	92,619	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	58,298	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	149,554	2025/03/20
	339 10年国債	0.4000	440,000	454,986	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	69,979	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	57,738	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	61,603	2025/06/20
	340 10年国債	0.4000	680,000	703,392	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	76,000	88,087	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	101,516	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	420,000	431,172	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	108,928	2025/12/20
	84 20年国債	2.0000	100,000	116,321	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	700,000	707,266	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	68,182	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	95,372	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	65,112	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	700,000	706,881	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	119,749	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	92,737	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	540,000	544,984	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	120,000	143,216	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	60,000	72,136	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	550,000	554,719	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	280,000	332,724	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	750,000	755,910	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	118,360	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	155,074	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	570,000	574,337	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	60,799	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	155,000	185,528	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	180,000	181,229	2027/09/20

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	
	97 20年国債	2. 2000	40, 000	48, 452	2027/09/20
	98 20年国債	2. 1000	120, 000	144, 187	2027/09/20
	99 20年国債	2. 1000	200, 000	241, 214	2027/12/20
	100 20年国債	2. 2000	55, 000	67, 106	2028/03/20
	101 20年国債	2. 4000	75, 000	93, 043	2028/03/20
	102 20年国債	2. 4000	80, 000	99, 559	2028/06/20
	103 20年国債	2. 3000	70, 000	86, 381	2028/06/20
	104 20年国債	2. 1000	110, 000	133, 437	2028/06/20
	105 20年国債	2. 1000	126, 000	153, 320	2028/09/20
	106 20年国債	2. 2000	150, 000	184, 131	2028/09/20
	107 20年国債	2. 1000	107, 000	130, 589	2028/12/20
	108 20年国債	1. 9000	177, 000	212, 031	2028/12/20
	109 20年国債	1. 9000	35, 000	42, 056	2029/03/20
	110 20年国債	2. 1000	130, 000	159, 116	2029/03/20
	111 20年国債	2. 2000	100, 000	123, 891	2029/06/20
	112 20年国債	2. 1000	170, 000	208, 676	2029/06/20
	1 30年国債	2. 8000	16, 000	20, 986	2029/09/20
	113 20年国債	2. 1000	230, 000	282, 962	2029/09/20
	114 20年国債	2. 1000	130, 000	160, 368	2029/12/20
	115 20年国債	2. 2000	160, 000	199, 273	2029/12/20
	2 30年国債	2. 4000	24, 000	30, 531	2030/02/20
	116 20年国債	2. 2000	89, 000	111, 151	2030/03/20
	117 20年国債	2. 1000	215, 000	265, 914	2030/03/20
	3 30年国債	2. 3000	30, 000	37, 887	2030/05/20
	118 20年国債	2. 0000	95, 000	116, 564	2030/06/20
	119 20年国債	1. 8000	93, 000	111, 752	2030/06/20
	120 20年国債	1. 6000	210, 000	247, 180	2030/06/20
	121 20年国債	1. 9000	135, 000	164, 245	2030/09/20
	122 20年国債	1. 8000	160, 000	192, 657	2030/09/20
	4 30年国債	2. 9000	36, 000	48, 463	2030/11/20
	123 20年国債	2. 1000	140, 000	174, 256	2030/12/20
	124 20年国債	2. 0000	143, 000	176, 168	2030/12/20
	125 20年国債	2. 2000	85, 000	107, 146	2031/03/20
	126 20年国債	2. 0000	70, 000	86, 368	2031/03/20
	127 20年国債	1. 9000	165, 000	201, 443	2031/03/20
	5 30年国債	2. 2000	28, 000	35, 361	2031/05/20
	128 20年国債	1. 9000	119, 000	145, 577	2031/06/20
	129 20年国債	1. 8000	160, 000	193, 625	2031/06/20
	130 20年国債	1. 8000	140, 000	169, 727	2031/09/20
	131 20年国債	1. 7000	130, 000	155, 758	2031/09/20
	6 30年国債	2. 4000	24, 000	31, 086	2031/11/20
	132 20年国債	1. 7000	120, 000	143, 997	2031/12/20
	133 20年国債	1. 8000	210, 000	254, 851	2031/12/20
	134 20年国債	1. 8000	50, 000	60, 776	2032/03/20
	135 20年国債	1. 7000	92, 000	110, 481	2032/03/20
	136 20年国債	1. 6000	155, 000	183, 997	2032/03/20
	7 30年国債	2. 3000	55, 000	70, 830	2032/05/20
	137 20年国債	1. 7000	85, 000	102, 222	2032/06/20
	138 20年国債	1. 5000	87, 000	102, 116	2032/06/20
	139 20年国債	1. 6000	125, 000	148, 575	2032/06/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	140 20年国債	1.7000	千円 335,000	千円 403,437	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	32,942	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	49,952	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	170,000	204,846	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	150,000	183,045	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	50,262	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	250,275	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	120,000	141,154	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	48,316	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	285,000	343,995	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	76,171	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	275,000	332,304	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	94,155	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	170,000	202,896	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	108,240	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	245,000	288,644	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	100,000	133,829	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	232,000	273,291	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	100,000	133,997	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	250,000	290,485	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	80,000	106,121	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	300,000	338,562	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	104,835	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	280,000	315,714	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	74,813	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	315,000	360,290	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	60,000	80,863	2035/09/20
	154 20年国債	1.2000	300,000	337,902	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	78,919	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	240,000	261,808	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	70,000	94,650	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	273,000	268,874	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	60,000	81,189	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	323,000	305,777	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	124,682	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	153,000	152,605	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	197,980	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	230,000	232,985	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	150,000	200,847	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	220,000	226,347	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	250,000	251,982	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	204,219	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	200,000	201,246	2037/09/20
	28 30年国債	2.5000	150,000	204,886	2038/03/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	270,050	2038/09/20
	30 30年国債	2.3000	177,000	236,257	2039/03/20
	31 30年国債	2.2000	165,000	217,560	2039/09/20
	32 30年国債	2.3000	200,000	268,430	2040/03/20
	33 30年国債	2.0000	261,000	334,604	2040/09/20
	34 30年国債	2.2000	213,000	282,640	2041/03/20

当		期	末		
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	35 30年国債	2.0000 %	250,000 千円	321,535 千円	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	226,000	291,225	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	290,000	367,795	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	159,000	198,284	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	152,000	193,196	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	140,000	174,792	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	140,000	171,593	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	146,000	179,013	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	160,000	196,252	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	140,000	171,781	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	168,000	198,110	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	180,000	212,508	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	167,000	201,240	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	190,000	219,413	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	173,000	199,749	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	185,000	185,212	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	190,000	165,805	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	205,000	189,057	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	195,000	184,719	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	188,000	187,332	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	190,000	189,319	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	130,000	129,377	2047/09/20
	1 40年国債	2.4000	85,000	120,660	2048/03/20
	2 40年国債	2.2000	116,000	159,029	2049/03/20
	3 40年国債	2.2000	74,000	101,892	2050/03/20
	4 40年国債	2.2000	107,000	147,740	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	165,585	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	136,223	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	149,732	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	150,000	171,418	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	258,000	211,621	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	165,000	160,571	2057/03/20
種 別 小 計	銘 柄 数	262銘柄			
	金 額		52,073,000	56,883,147	
地方債証券	665 東京都公債	1.4300	100,000	101,485	2018/12/20
	21-2 千葉県公債	1.5700	100,000	102,270	2019/05/24
	163 神奈川県公債	1.4000	100,000	102,120	2019/06/20
	21-3 埼玉県公債	1.6400	100,000	102,510	2019/06/25
	76 共同発行地方	1.4000	50,000	51,125	2019/07/25
	21-6 千葉県公債	1.4100	100,000	102,498	2019/09/25
	81 共同発行地方	1.3200	100,000	102,655	2019/12/25
	21-3 広島市公債	1.3400	100,000	102,697	2019/12/25
	21-5 京都市公債	1.4500	100,000	103,156	2020/02/25
	471 名古屋市債	1.2700	100,000	103,134	2020/06/19
	688 東京都公債	0.9400	100,000	102,512	2020/09/18
	90 共同発行地方	1.1200	100,000	103,018	2020/09/25
	22-1 岡山県公債	1.0500	100,000	103,017	2020/11/30
	22-5 京都府公債	1.2600	100,000	103,716	2020/12/21
	699 東京都公債	1.0200	100,000	103,758	2021/09/17

日本債券インデックスマザーファンド

当		期	末		
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	23-2 島根県公債	1.0300	100,000	103,941	2021/11/25
	108 共同発行地方	1.0100	100,000	104,175	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	104,123	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	103,585	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	103,955	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	103,695	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	103,481	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	103,701	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	103,628	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	103,391	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	103,431	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	103,633	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	102,115	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	104,299	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	207,313	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	103,608	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	102,982	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,573	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	206,608	2025/04/16
	751 東京都公債	0.3700	100,000	102,001	2025/12/19
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	199,496	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,122	2027/06/23
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	116,231	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	116,411	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	106,966	2035/12/20
種 別 小 計	銘 柄 数	40銘柄			
	金 額		4,250,000	4,405,150	
特殊債券（除く金融債券）	24 政保中日本道	1.3000	100,000	101,483	2019/01/22
	14政保地方公共6	0.1990	100,000	100,468	2020/06/18
	61 道路機構	1.2400	100,000	103,015	2020/06/19
	13 地方公共団体	1.2780	100,000	103,153	2020/06/26
	110 政保道路機構	1.3000	100,000	103,313	2020/06/30
	3 公営企業15年	2.2000	100,000	107,589	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	103,792	2021/10/28
	81 道路機構	1.0300	100,000	103,789	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	104,147	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	104,006	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	103,865	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	103,721	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	103,900	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	103,840	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	104,181	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	103,435	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	103,449	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	103,982	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	103,191	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	104,313	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,941	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	102,021	2025/01/31

当		期	末		
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,562	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	204,847	2025/11/28
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	110,958	2027/08/25
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	111,039	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	120,509	2029/07/31
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	184,952	2036/07/31
種 別 小 計	銘 柄 数	28銘柄			
	金 額		3,000,000	3,112,472	
金融債券		19 利付商工債	0.1000	100,000	98,784
					2026/09/18
種 別 小 計	銘 柄 数	1銘柄			
	金 額		100,000	98,784	
普通社債券		18 西日本旅客鉄	1.7000	100,000	101,725
	4 リゾな銀行劣後	2.7660	100,000	104,117	2018/12/11
	46 NTT ファイナンス	0.2500	100,000	100,333	2019/06/20
	14 武田薬品	0.5400	100,000	100,783	2019/06/20
	20 三井住友 BK 劣	2.2100	100,000	100,783	2019/07/19
	164 オリックス	1.1460	100,000	103,487	2019/07/24
	24 太平洋セメント	1.1460	100,000	101,821	2019/08/07
	423 九州電力	0.3900	100,000	101,821	2019/08/07
	62東日本旅客鉄道	0.9590	100,000	100,442	2019/09/11
	8ドイツ銀行 AG ロンドン	1.4240	100,000	100,442	2019/09/11
	29 東日本高速道	0.4700	100,000	101,650	2019/09/25
	260 北陸電力	1.1800	100,000	102,529	2019/09/27
	9 AUST・NZ 銀行	0.3430	100,000	100,217	2019/11/14
	20 東京三菱銀行	0.1800	100,000	100,217	2019/11/14
	15 トヨタファイナンス	2.3300	100,000	100,257	2020/03/19
	17 シティグループ・インク	0.4300	100,000	105,627	2020/05/25
	72東日本旅客鉄道	2.5700	100,000	100,392	2020/07/24
	44 野村ホールディング	1.8000	100,000	106,723	2020/07/27
	2 イオンFS	2.0400	100,000	104,724	2020/08/21
	9三菱UFJ 信託 BK 劣	1.2800	100,000	105,128	2020/09/16
	11 セブンアンドアイ	0.7230	100,000	103,695	2020/12/22
	11三菱UFJ 信託BK	0.5720	100,000	101,656	2021/02/25
	372 中国電力	0.6800	100,000	101,656	2021/02/25
	4 JX ホールディングス	0.5140	100,000	100,638	2021/03/18
	30 大阪瓦斯	1.6800	100,000	100,638	2021/03/18
	175 オリックス	0.5140	100,000	105,128	2021/04/28
	21 西日本高速道	1.3600	100,000	101,830	2022/06/20
	1 三菱UFJFG 劣後	1.2040	100,000	105,283	2022/06/27
	20 成田国際空港	1.1450	100,000	104,967	2022/08/25
	41 東海旅客鉄道	0.7590	100,000	104,842	2022/12/14
	107東日本旅客鉄	1.0640	100,000	104,842	2022/12/14
		0.7540	100,000	103,214	2022/12/14
		0.9400	100,000	104,500	2023/11/24
		0.1050	100,000	103,586	2023/12/20
		2.1660	100,000	99,126	2026/08/21
		1.4150	100,000	120,258	2029/01/29
				110,697	2045/01/27
種 別 小 計	銘 柄 数	31銘柄			
	金 額		3,100,000	3,212,890	
合 計	銘 柄 数	362銘柄			
	金 額		62,523,000	67,712,446	

(注) 単位未満は切捨て。

日本債券インデックスマザーファンド

■投資信託財産の構成

項 目	2017年11月30日現在	
	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	67,712,446	99.2
コール・ローン等、その他	515,486	0.8
投資信託財産総額	68,227,933	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在	
項 目	当 期 末
(A) 資産	68,227,933,193円
コール・ローン等	328,217,271
公社債（評価額）	67,712,446,580
未収利息	181,873,953
前払費用	5,395,389
(B) 負債	88,741,204
未払解約金	88,741,204
(C) 純資産総額（A－B）	68,139,191,989
元本	48,889,824,254
次期繰越損益金	19,249,367,735
(D) 受益権総口数	48,889,824,254口
1万口当り基準価額（C／D）	13,937円

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

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

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,937円です。

■損益の状況

当期 自 2016年12月1日 至 2017年11月30日	
項 目	当 期
(A) 配当等収益	611,733,917円
受取利息	611,905,675
支払利息	△ 171,758
(B) 有価証券売買損益	△ 819,398,131
売買益	52,133,060
売買損	△ 871,531,191
(C) その他費用	△ 2,372
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 207,666,586
(E) 前期繰越損益金	14,852,652,444
(F) 解約差損益金	△ 1,815,204,560
(G) 追加信託差損益金	6,419,586,437
(H) 合計（D＋E＋F＋G）	19,249,367,735
次期繰越損益金（H）	19,249,367,735

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

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

ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用)

運用報告書(全体版) 第 2 期

(決算日 2018年 6 月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果をFTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	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FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 ②運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ③投資成果をFTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させるため、外貨建資産については為替ヘッジを行ないます。		
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 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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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

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、「ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

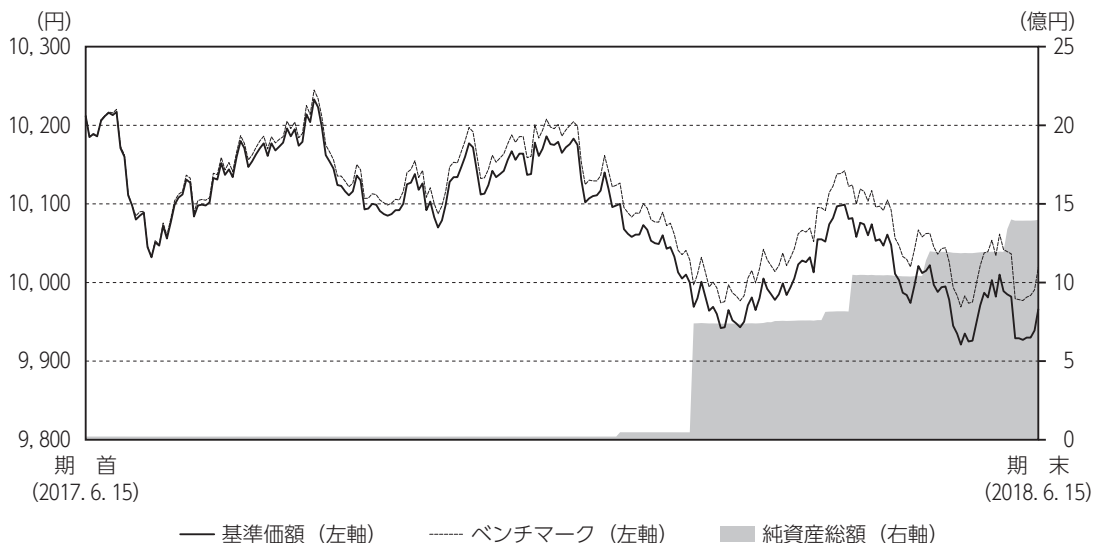
決 算 期	基 準 価 額			FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率	純資産 総 額
		税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6 月15日)	10, 212	0	2. 1	10, 230	2. 3	93. 8	4. 0	20
2 期末 (2018年 6 月15日)	9, 966	0	△ 2. 4	10, 037	△ 1. 9	95. 4	2. 1	1, 398

- (注 1) FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10, 000として大和投資信託が計算したものです。FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営されている債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
- (注 2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注 3) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
- (注 4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
- (注 5) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

基準価額・騰落率

期首：10,212円

期末：9,966円

騰落率：△2.4%

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、主要国の金利が上昇（債券価格の下落）したことなどから、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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）

年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2017年 6 月15日	円	%		%	%	%
	10, 212	—	10, 230	—	93. 8	4. 0
6 月末	10, 111	△ 1. 0	10, 131	△ 1. 0	98. 0	1. 0
7 月末	10, 098	△ 1. 1	10, 123	△ 1. 1	95. 3	0. 9
8 月末	10, 186	△ 0. 3	10, 214	△ 0. 2	98. 5	—
9 月末	10, 094	△ 1. 2	10, 125	△ 1. 0	97. 8	1. 7
10 月末	10, 128	△ 0. 8	10, 165	△ 0. 6	93. 2	3. 4
11 月末	10, 137	△ 0. 7	10, 177	△ 0. 5	95. 5	1. 5
12 月末	10, 119	△ 0. 9	10, 160	△ 0. 7	92. 1	6. 7
2018年 1 月末	10, 005	△ 2. 0	10, 053	△ 1. 7	91. 1	3. 9
2 月末	9, 965	△ 2. 4	10, 017	△ 2. 1	91. 4	1. 6
3 月末	10, 097	△ 1. 1	10, 156	△ 0. 7	97. 0	—
4 月末	9, 996	△ 2. 1	10, 060	△ 1. 7	95. 7	2. 9
5 月末	9, 982	△ 2. 3	10, 052	△ 1. 7	93. 4	1. 6
(期末)2018年 6 月15日	9, 966	△ 2. 4	10, 037	△ 1. 9	95. 4	2. 1

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■外国債券市況

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

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

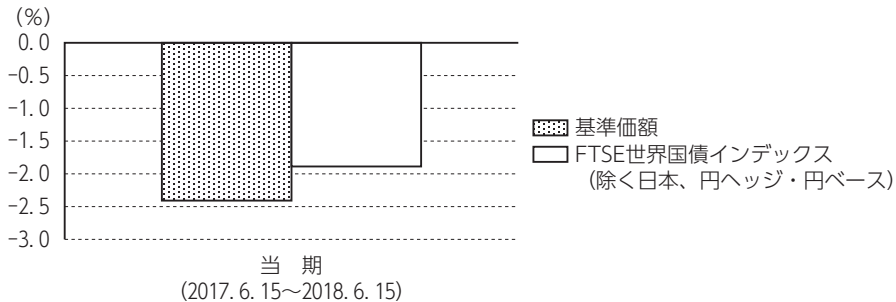
外貨建資産については為替ヘッジを行ない、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

ベンチマークとの差異について

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

当期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.07%程度でした。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益やポートフォリオの利回り水準等を勘案し、収益分配は行ないませんでした。

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（1万口当たり）

項 目		当 期
		2017年6月16日 ～2018年6月15日
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	227

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 6. 16～2018. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	41円	0. 410%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10, 079円です。
(投 信 会 社)	(28)	(0. 281)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(11)	(0. 108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0. 022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0. 002	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先 物)	(0)	(0. 002)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	2	0. 023	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0. 014)	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. 009)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0. 001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	44	0. 436	

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

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス （為替ヘッジあり） マザーファンド	1,444,046	1,383,348	63	61

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■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

期首保有額	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

(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	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国債券インデックス （為替ヘッジあり）マザーファンド	20,818	1,464,801	1,397,567

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス （為替ヘッジあり）マザーファンド	1,397,567	99.8
コール・ローン等、その他	2,661	0.2
投資信託財産総額	1,400,228	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,400,228,652円
コール・ローン等	2,661,170
外国債券インデックス（為替ヘッジあり） マザーファンド（評価額）	1,397,567,482
(B) 負債	1,470,977
未払信託報酬	1,442,560
その他未払費用	28,417
(C) 純資産総額（A－B）	1,398,757,675
元本	1,403,467,254
次期繰越損益金	△ 4,709,579
(D) 受益権総口数	1,403,467,254口
1万口当り基準価額（C／D）	9,966円

*期首における元本額は19,852,947円、当期中における追加設定元本額は1,383,614,307円、同解約元本額は0円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,966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4,709,579円です。

■ 損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 270円
支払利息	△ 270
(B) 有価証券売買損益	△ 5,990,644
売買損	△ 5,990,644
(C) 信託報酬等	△ 1,513,054
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 7,503,968
(E) 前期繰越損益金	274,658
(F) 追加信託差損益金	2,519,731
(配当等相当額)	(23,894,920)
(売買損益相当額)	(△ 21,375,189)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 4,709,579
次期繰越損益金 (G)	△ 4,709,579
追加信託差損益金	2,519,731
(配当等相当額)	(23,894,920)
(売買損益相当額)	(△ 21,375,189)
分配準備積立金	8,026,527
繰越損益金	△ 15,255,837

- (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	7,751,869円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	23,894,920
(d) 分配準備積立金	274,658
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	31,921,447
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	31,921,447
(h) 受益権総口数	1,403,467,254口

《お知らせ》

■運用において参照している指数の名称変更について

「シティ世界国債インデックス」を「FTSE 世界国債インデックス」に変更しました。

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

運用報告書 第2期（決算日 2018年6月15日）

（計算期間 2017年6月16日～2018年6月15日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

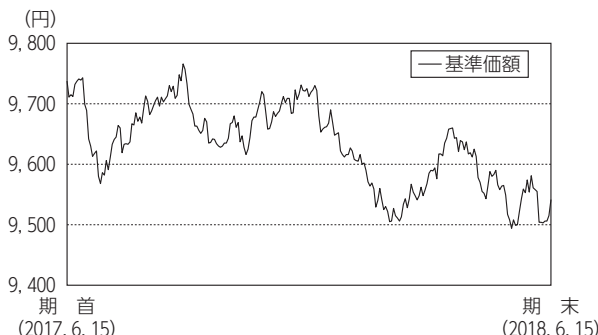
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース） （ベンチマーク）		公社債組入率 %	債券先比率 %
	円	騰落率 %	円	騰落率 %		
(期首) 2017年6月15日	9,737	—	9,751	—	93.8	4.0
6月末	9,642	△ 1.0	9,656	△ 1.0	98.0	1.0
7月末	9,633	△ 1.1	9,649	△ 1.1	95.4	0.9
8月末	9,720	△ 0.2	9,736	△ 0.2	98.5	—
9月末	9,636	△ 1.0	9,651	△ 1.0	97.8	1.7
10月末	9,672	△ 0.7	9,689	△ 0.6	93.2	3.4
11月末	9,684	△ 0.5	9,700	△ 0.5	95.5	1.5
12月末	9,670	△ 0.7	9,684	△ 0.7	92.1	6.7
2018年1月末	9,564	△ 1.8	9,582	△ 1.7	91.2	3.9
2月末	9,528	△ 2.1	9,548	△ 2.1	91.5	1.6
3月末	9,658	△ 0.8	9,681	△ 0.7	97.1	—
4月末	9,564	△ 1.8	9,588	△ 1.7	95.8	2.9
5月末	9,554	△ 1.9	9,581	△ 1.7	93.5	1.6
(期末) 2018年6月15日	9,541	△ 2.0	9,567	△ 1.9	95.5	2.1

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

(注4) 公社債組入率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注5) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：9,737円 期末：9,541円 騰落率：△2.0%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○外国債券市況

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

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

(注 2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 公 社 債

(2017年 6月16日から2018年 6月15日まで)

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

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

(注 1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

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

(注 3) 単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種別取引状況

(2017年 6月16日から2018年 6月15日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 単位未満は切捨て。

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

■主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年 6月16日から2018年 6月15日まで)

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

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

■組入資産明細表
(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

作 成 期	当 期				期 末			
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちB B格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5 年以上	2 年以上	2 年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 250,848	千アメリカ・ドル 247,571	千円 27,401,194	41.6 %	% —	% 17.9	% 17.7	% 6.0
カナダ	千カナダ・ドル 15,864	千カナダ・ドル 16,695	1,407,919	2.1	—	0.8	0.6	0.8
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 15,297	千オーストラリア・ドル 16,399	1,353,423	2.1	—	1.3	0.6	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 2,667	千シンガポール・ドル 2,685	220,728	0.3	—	0.2	0.0	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 24,047	千イギリス・ポンド 30,675	4,498,881	6.8	—	5.2	1.1	0.5
スイス	千スイス・フラン 552	千スイス・フラン 682	75,715	0.1	—	0.1	0.0	—
デンマーク	千デンマーク・クローネ 16,410	千デンマーク・クローネ 20,239	347,506	0.5	—	0.4	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 9,650	千ノルウェー・クローネ 9,975	135,667	0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 15,650	千スウェーデン・クローネ 17,882	226,032	0.3	—	0.2	0.1	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 82,030	千メキシコ・ペソ 81,660	433,614	0.7	—	0.4	0.2	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 10,330	千マレーシア・リンギット 10,123	281,223	0.4	—	0.3	0.1	0.0
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 41,430	千南アフリカ・ランド 38,181	313,856	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 13,175	千ポーランド・ズロチ 13,504	402,985	0.6	—	0.2	0.3	0.1
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 3,678	千ユーロ 4,139	529,453	0.8	—	0.4	0.3	0.1

外国債券インデックス（為替ヘッジあり） マザーファンド

作 成 期	当 期 末							
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちＢＢ格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		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 (オランダ)	千ユーロ 9,212	千ユーロ 10,695	千円 1,367,958	% 2.1	% —	% 1.4	% 0.5	% 0.2
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 11,130	千ユーロ 12,439	1,590,975	2.4	—	1.8	0.5	0.1
ユーロ (フランス)	千ユーロ 44,510	千ユーロ 52,249	6,682,731	10.2	—	6.4	3.1	0.6
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 31,694	千ユーロ 36,291	4,641,639	7.1	—	4.0	2.1	0.9
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 25,130	千ユーロ 29,111	3,723,340	5.7	—	3.9	1.2	0.5
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 40,799	千ユーロ 45,788	5,856,341	8.9	—	5.6	2.6	0.7
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 2,710	千ユーロ 2,982	381,408	0.6	—	0.3	0.2	0.1
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 6,180	千ユーロ 7,423	949,499	1.4	—	1.0	0.4	—
ユーロ (小計)	175,043	201,120	25,723,348	39.1	—	24.7	11.1	3.3
合計	—	—	62,822,098	95.5	—	52.3	32.1	11.1

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

(注 2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注 3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

当 期 末							
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	% 2.6250	千アメリカ・ドル 25,370	千アメリカ・ドル 25,359	千円 2,806,744	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	10,040	10,287	1,138,607	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	11,946	11,659	1,290,464	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,700	6,374	705,546	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	7,950	7,782	861,375	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	11,020	10,481	1,160,038	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,540	7,433	822,785	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,310	3,257	360,511	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,905	5,877	650,500	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	10,580	10,363	1,147,024	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,990	4,906	543,058	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	2,250	2,836	313,989	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	3,000	3,986	441,198	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,130	1,416	156,774	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,250	1,511	167,262	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,330	3,581	396,405	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	410	497	55,035	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	350	439	48,591	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	670	857	94,913	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,970	3,008	332,930	2042/02/15

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

当 期 末							
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. 8750	8, 210	7, 945	879, 432	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 6250	1, 100	1, 208	133, 751	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 7500	332	372	41, 189	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 3750	2, 600	2, 745	303, 839	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 1250	3, 190	3, 226	357, 065	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 5000	12, 440	12, 274	1, 358, 505	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 2500	9, 810	9, 438	1, 044, 706	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 7500	13, 150	12, 681	1, 403, 584	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 0000	1, 570	1, 552	171, 784	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 0000	12, 320	11, 591	1, 282, 921	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 7500	16, 720	16, 013	1, 772, 346	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 2500	3, 900	3, 724	412, 257	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 6250	2, 000	1, 820	201, 470	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 6250	1, 165	1, 057	117, 065	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 5000	2, 070	1, 850	204, 835	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 5000	1, 000	895	99, 152	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 0000	2, 350	2, 185	241, 870	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 8750	2, 480	2, 389	264, 426	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 0000	10, 500	10, 282	1, 138, 025	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 2500	5, 120	4, 849	536, 704	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 6250	5, 500	5, 412	599, 061	2020/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 3750	1, 850	1, 767	195, 654	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 0000	2, 250	2, 222	245, 934	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 7500	6, 310	5, 923	655, 558	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 1250	2, 200	2, 225	246, 291	2048/05/15
通貨小計	銘柄数 金 額	45銘柄		250, 848	247, 571	27, 401, 194	
				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2. 7500	460	524	44, 195	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 7500	707	942	79, 500	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 7500	250	358	30, 199	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 0000	668	941	79, 369	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 0000	170	220	18, 585	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 5000	5, 820	5, 992	505, 362	2020/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	400	409	34, 569	2022/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 5000	880	1, 091	92, 009	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	1, 238	1, 200	101, 233	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5000	230	233	19, 722	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	592	592	49, 989	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	320	302	25, 522	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 7500	1, 959	1, 880	158, 541	2021/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 0000	930	834	70, 406	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	1, 240	1, 170	98, 710	2022/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		15, 864	16, 695	1, 407, 919	
				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 7500	1, 770	1, 949	160, 915	2021/05/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 5000	800	835	68, 926	2020/04/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 7500	1, 080	1, 226	101, 229	2022/07/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 5000	1, 383	1, 581	130, 488	2023/04/21

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		当 期			末		
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額	
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額
				%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 7500	1, 089	1, 265	104, 442
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	656	665	54, 939
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 2500	920	964	79, 591
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 2500	1, 200	1, 251	103, 249
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 5000	859	1, 023	84, 430
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 2500	998	1, 111	91, 727
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	300	302	25, 003
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 7500	725	796	65, 697
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 7500	400	396	32, 743
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 2500	684	697	57, 527
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	2, 158	2, 069	170, 808
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 0000	275	262	21, 703
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄			15, 297	16, 399	1, 353, 423
シンガポール					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3. 5000	203	218	17, 958
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 5000	125	125	10, 345
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3. 0000	150	155	12, 764
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 8750	300	305	25, 091
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 2500	390	392	32, 224
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 7500	89	86	7, 074
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 7500	200	204	16, 805
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3. 3750	120	127	10, 499
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1. 6250	300	299	24, 600
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 3750	400	398	32, 748
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 7500	330	317	26, 128
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 2500	60	54	4, 487
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄			2, 667	2, 685	220, 728
イギリス					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	
		United Kingdom Gilt	国債証券	2. 0000	750	793	116, 359
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 5000	1, 300	1, 325	194, 331
		United Kingdom Gilt	国債証券	2. 5000	910	1, 193	175, 100
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 5000	525	534	78, 385
		United Kingdom Gilt	国債証券	0. 5000	250	245	36, 047
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 2500	850	840	123, 338
		United Kingdom Gilt	国債証券	6. 0000	863	1, 248	183, 042
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 2500	350	465	68, 326
		United Kingdom Gilt	国債証券	5. 0000	675	843	123, 739
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 2500	1, 165	1, 618	237, 323
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 7500	1, 090	1, 167	171, 159
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 2500	620	963	141, 367
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 5000	411	633	92, 959
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 7500	907	1, 238	181, 620
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 2500	1, 893	3, 050	447, 424
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 2500	1, 430	2, 063	302, 673
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 0000	1, 040	1, 161	170, 321
		United Kingdom Gilt	国債証券	3. 7500	1, 045	1, 085	159, 135
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 0000	787	1, 361	199, 655
		United Kingdom Gilt	国債証券	3. 7500	810	864	126, 829

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

		当 期			末		
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	
			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	742	811	119,054	2021/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	580	599	87,961	2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,425	1,853	271,896	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,290	1,369	200,819	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	748	1,251	183,597	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	300	329	48,295	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,290	1,759	258,113	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	27銘柄		24,047	30,675	4,498,881	
スイス	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	282	393	43,597	2028/04/08
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	120	127	14,158	2020/07/06
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	150	161	17,959	2021/04/28
通貨小計	銘柄数 金 額	3銘柄		552	682	75,715	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	4,140	7,011	120,388	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,760	2,942	50,514	2019/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,310	2,580	44,307	2021/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,670	2,896	49,730	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,330	2,597	44,597	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	2,211	37,967	2027/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		16,410	20,239	347,506	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	2,620	2,820	38,353	2021/05/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,150	1,183	16,094	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,300	1,407	19,147	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	150	151	2,060	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,430	1,412	19,216	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,000	2,999	40,795	2027/02/17
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		9,650	9,975	135,667	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	2,780	3,165	40,007	2020/12/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,920	2,715	34,322	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,950	3,393	42,898	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,150	2,328	29,438	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,020	2,342	29,607	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,280	1,344	16,991	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,592	32,766	2028/05/12
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		15,650	17,882	226,032	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.0000	5,400	5,185	27,534	2019/12/11
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	4,200	3,669	19,485	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	1,450	1,445	7,675	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	6,740	6,747	35,828	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,340	7,004	37,193	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	4,800	4,664	24,770	2027/06/03

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

		当 期			未			
区 分		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
				%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,750	3,279	17,415	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,500	6,762	35,908	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	5,000	5,246	27,858	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	5,500	5,519	29,309	2020/06/11
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	13,700	13,192	70,050	2021/06/10
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	2,700	2,652	14,085	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	8,900	8,448	44,862	2022/06/09
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	4,750	4,613	24,496	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	3,300	3,228	17,140	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄			82,030	81,660	433,614	
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,760	1,741	48,374	2030/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,250	1,207	33,549	2027/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,050	1,049	29,152	2020/03/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	600	541	15,037	2033/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,150	1,128	31,353	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,100	1,095	30,425	2022/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	600	595	16,533	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	1,420	1,374	38,178	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	400	399	11,102	2021/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,000	990	27,515	2037/04/07
通貨小計	銘柄数 金 額	10銘柄			10,330	10,123	281,223	
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	1,210	1,205	9,909	2020/01/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	5,010	5,469	44,958	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	1,200	1,166	9,585	2021/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	2,610	1,832	15,060	2041/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	2,900	2,838	23,330	2023/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	8,400	7,536	61,949	2048/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	5,250	4,718	38,786	2037/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	2,850	2,579	21,201	2030/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	2,300	2,070	17,017	2044/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	9,700	8,766	72,058	2032/03/31
通貨小計	銘柄数 金 額	10銘柄			41,430	38,181	313,856	
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,200	1,367	40,798	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	5.5000	1,120	1,182	35,280	2019/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.5000	1,340	1,339	39,968	2020/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	640	612	18,284	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,000	2,009	59,972	2021/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.7500	1,520	1,512	45,143	2021/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,815	1,719	51,316	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	800	801	23,924	2022/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	600	742	22,158	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	710	760	22,691	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,430	1,455	43,446	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄			13,175	13,504	402,985	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

当 期				未				
区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
ユーロ（アイルランド）	IRISH TREASURY	国債証券	4.4000	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	290	304	38,895	2019/06/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	288	382	48,932	2025/03/13	
	IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	910	1,027	131,428	2020/10/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	420	497	63,684	2023/03/20	
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	100	118	15,124	2024/03/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	680	774	99,064	2030/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	310	324	41,547	2045/02/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	320	328	42,017	2026/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	170	173	22,201	2037/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	4.5000	190	207	26,555	2020/04/18	
国 小 計	銘柄数 金 額	10銘柄			3,678	4,139	529,453	
ユーロ（オランダ）	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	千ユーロ	千ユーロ			
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	580	853	109,187	2028/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	455	692	88,553	2037/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,170	1,384	177,057	2023/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	200	210	26,874	2019/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	175	190	24,322	2020/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	430	672	86,048	2042/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	492	549	70,244	2021/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	590	723	92,536	2033/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	540	750	95,969	2047/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	380	424	54,319	2024/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	850	862	110,289	2020/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	690	691	88,425	2025/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	370	374	47,896	2026/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	420	425	54,414	2022/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	470	481	61,579	2027/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	799	102,253	2024/01/15	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	600	609	77,984	2028/07/15		
国 小 計	銘柄数 金 額	17銘柄			9,212	10,695	1,367,958	
ユーロ（ベルギー）	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	千ユーロ	千ユーロ			
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	670	691	88,418	2025/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,022	1,016	130,034	2031/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	410	442	56,551	2038/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	618	79,069	2026/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	564	550	70,465	2047/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	400	403	51,616	2023/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	580	587	75,134	2027/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	340	43,556	2057/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	680	681	87,114	2028/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	504	64,524	2033/04/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	200	313	40,112	2035/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	550	640	81,928	2022/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	534	586	75,031	2020/09/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	665	1,018	130,222	2041/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	500	577	73,802	2021/09/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	300	394	50,402	2026/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	730	871	111,455	2022/09/28	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

		当 期			未			
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	
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	千ユーロ 700	千ユーロ 731	千円 93,614	2019/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	120	175	22,424	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	916	117,261	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	377	48,232	2034/06/22
国 小 計	銘柄数 金 額	21銘柄			11,130	12,439	1,590,975	
ユーロ（フランス）	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	千ユーロ 2,415	千ユーロ 3,429	438,579	2025/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,000	1,495	191,315	2029/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	900	1,473	188,438	2032/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,310	2,037	260,565	2035/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,182	1,904	243,588	2055/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	650	728	93,140	2021/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,065	1,579	202,014	2038/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,200	1,475	188,765	2023/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	743	1,191	152,449	2041/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	860	910	116,420	2019/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	500	537	68,744	2020/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,040	1,294	165,578	2026/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,270	4,572	584,837	2020/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,514	1,698	217,286	2021/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	2,142	274,047	2022/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,710	2,045	261,595	2027/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	995	1,101	140,883	2022/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	870	1,193	152,656	2045/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,530	1,668	213,435	2023/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,400	1,578	201,909	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,486	2,942	376,381	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,060	1,166	149,193	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,690	1,716	219,503	2019/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,219	155,990	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	600	603	77,238	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,036	388,331	2021/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,570	2,517	322,030	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	650	693	88,690	2039/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	900	971	124,211	2048/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,204	154,103	2023/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,300	1,305	166,928	2028/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	800	812	103,874	2034/05/25	
国 小 計	銘柄数 金 額	32銘柄			44,510	52,249	6,682,731	
ユーロ（ドイツ）	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	千ユーロ 855	千ユーロ 1,328	169,867	2027/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,146	1,884	241,069	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	160	255	32,625	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	370	591	75,596	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	890	1,365	174,591	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	720	1,173	150,131	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	360	631	80,714	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,334	1,392	178,159	2019/07/04	

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		当 期			末		
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額	
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	306	451	57,771
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,655	2,890	369,640
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,542	1,675	214,273
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,248	1,649	211,034
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,150	1,245	159,247
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	960	1,068	136,621
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	500	552	70,633
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	725	968	123,856
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	990	1,080	138,257
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,225	156,776
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,800	1,914	244,914
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	883	904	115,734
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	950	931	119,102
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,000	995	127,306
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	1,012	129,477
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	280	286	36,665
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	251	32,190
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,440	1,458	186,489
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,923	245,972
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,440	3,509	448,810
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,522	194,727
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	150	151	19,376
国 小 計	銘柄数 金 額	30銘柄			31,694	36,291	4,641,639
ユーロ（スペイン）					千ユーロ	千ユーロ	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,320	1,911	244,506
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	500	527	67,490
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	610	632	80,933
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,865	2,027	259,297
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	1,025	131,224
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	889	971	124,271
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	280	330	42,236
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,749	1,777	227,316
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	350	353	45,273
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	600	614	78,604
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	920	974	124,589
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	670	680	86,977
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	350	351	44,943
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	280	421	53,933
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	800	1,072	137,118
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	400	589	75,344
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6000	1,238	1,307	167,204
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	943	1,359	173,866
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,600	1,789	228,826
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	724	840	107,473
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,140	1,379	176,435
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	810	1,000	128,008
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,588	1,919	245,544
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	600	815	104,265
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	340	524	67,065

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		当 期			末		
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額	
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	700	829	106,054
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,384	1,563	200,009
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,480	1,520	194,525
国 小 計	銘柄数 金 額	28銘柄			25,130	29,111	3,723,340
ユーロ（イタリア）					千ユーロ	千ユーロ	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	800	1,080	138,179
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,135	2,792	357,217
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	705	684	87,513
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	871	111,499
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	200	187	24,002
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	690	586	74,950
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	600	553	70,784
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	500	482	61,700
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,500	1,485	190,025
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	350	345	44,223
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	469	60,024
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	740	901	115,291
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,288	1,682	215,193
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,000	1,301	166,406
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,050	1,290	165,118
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	770	852	109,060
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	702	756	96,736
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,640	2,021	258,517
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,570	1,789	228,857
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	3,470	3,625	463,669
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,700	1,984	253,812
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	664	818	104,628
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	3,050	3,255	416,399
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,850	2,111	270,110
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,650	1,767	226,067
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,320	1,465	187,476
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	780	878	112,332
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	2,770	3,206	410,125
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,480	1,721	220,233
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	395	476	60,997
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	830	937	119,861
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,110	2,295	293,630
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	370	387	49,592
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	700	720	92,102
国 小 計	銘柄数 金 額	34銘柄			40,799	45,788	5,856,341
ユーロ（フィンランド）					千ユーロ	千ユーロ	
		Finland Government Bond	国債証券	0.7500	190	187	23,936
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	180	181	23,191
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	200	198	25,364
		Finland Government Bond	国債証券	4.3750	80	84	10,771
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	252	32,242
		Finland Government Bond	国債証券	3.3750	200	214	27,440
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	120	144	18,498

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		当 期			末		
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額	
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円
		Finland Government Bond	国債証券	1. 6250	980	1, 057	135, 223
		Finland Government Bond	国債証券	2. 6250	210	273	34, 963
		Finland Government Bond	国債証券	2. 0000	350	389	49, 775
国 小 計	銘柄数 金 額	10銘柄			2, 710	2, 982	381, 408
ユーロ（オーストリア）		Austria Government Bond	国債証券	1. 2000	440	467	59, 744
		Austria Government Bond	国債証券	0. 7500	490	499	63, 929
		Austria Government Bond	国債証券	1. 5000	120	119	15, 336
		Austria Government Bond	国債証券	0. 5000	400	397	50, 806
		Austria Government Bond	国債証券	6. 2500	380	572	73, 285
		Austria Government Bond	国債証券	3. 9000	480	524	67, 091
		Austria Government Bond	国債証券	3. 5000	660	744	95, 208
		Austria Government Bond	国債証券	4. 1500	510	761	97, 450
		Austria Government Bond	国債証券	3. 4000	860	997	127, 634
		Austria Government Bond	国債証券	3. 8000	420	705	90, 253
		Austria Government Bond	国債証券	3. 1500	180	248	31, 801
		Austria Government Bond	国債証券	1. 7500	680	744	95, 196
		Austria Government Bond	国債証券	2. 4000	280	332	42, 587
		Austria Government Bond	国債証券	1. 6500	280	306	39, 172
国 小 計	銘柄数 金 額	14銘柄			6, 180	7, 423	949, 499
通貨小計	銘柄数 金 額	196銘柄			175, 043	201, 120	25, 723, 348
合 計	銘柄数 金 額	379銘柄					62, 822, 098

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

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

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

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	62, 822, 098	94. 2
コール・ローン等、その他	3, 835, 479	5. 8
投資信託財産総額	66, 657, 577	100. 0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝110.68円、1カナダ・ドル＝84.33円、1オーストラリア・ドル＝82.53円、1シンガポール・ドル＝82.20円、1イギリス・ポンド＝146.66円、1スイス・フラン＝110.92円、1デンマーク・クローネ＝17.17円、1ノルウェー・クローネ＝13.60円、1スウェーデン・クローネ＝12.64円、1メキシコ・ペソ＝5.31円、1マレーシア・リンギット＝27.78円、1南アフリカ・ランド＝8.22円、1ポーランド・ズロチ＝29.84円、1ユーロ＝127.90円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（63,653,511千円）の投資信託財産総額（66,657,577千円）に対する比率は、95.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

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

*期首における元本額は35,493,735,600円、当期中における追加設定元本額は37,519,095,983円、同解約元本額は4,043,466,194円です。
*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）64,035,275,304円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）3,469,288,196円、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）1,464,801,889円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は9,541円です。
*当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は3,167,814,868円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

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

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

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

ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果をFTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債
マザーファンドの運用方法	①主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

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

運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2018年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先（コールセンター）

TEL 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

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

<5697>

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・ 円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6 月15日)	10,065	25	0.9	10,071	0.7	98.8	—	1
2 期末 (2018年 6 月15日)	10,028	120	0.8	10,251	1.8	98.6	—	1

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

(注 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。

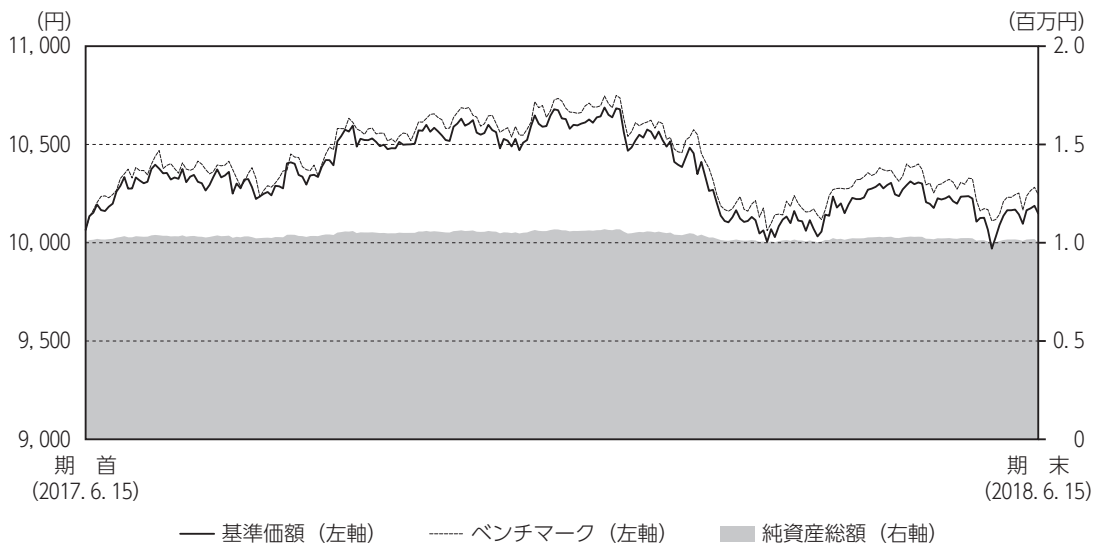
(注 5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(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 1）期末の基準価額は分配金込みです。

（注 2）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

基準価額・騰落率

期首：10,065円

期末：10,028円（分配金120円）

騰落率：0.8%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

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

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

年 月 日	基 準 価 額		FSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2017年 6 月15日	円	%		%	%	%
	10,065	—	10,071	—	98.8	—
6 月末	10,275	2.1	10,381	3.1	98.5	—
7 月末	10,266	2.0	10,380	3.1	98.5	—
8 月末	10,409	3.4	10,458	3.8	98.4	—
9 月末	10,522	4.5	10,586	5.1	98.7	—
10 月末	10,518	4.5	10,590	5.1	98.6	—
11 月末	10,523	4.6	10,584	5.1	98.3	—
12 月末	10,651	5.8	10,714	6.4	98.3	—
2018年 1 月末	10,385	3.2	10,465	3.9	98.0	—
2 月末	10,115	0.5	10,221	1.5	97.8	—
3 月末	10,179	1.1	10,282	2.1	98.4	—
4 月末	10,298	2.3	10,396	3.2	98.4	—
5 月末	10,030	△ 0.3	10,124	0.5	98.1	—
(期末)2018年 6 月15日	10,148	0.8	10,251	1.8	98.6	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■外国債券市況

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

■為替相場

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

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れました。

■外国債券インデックスマザーファンド

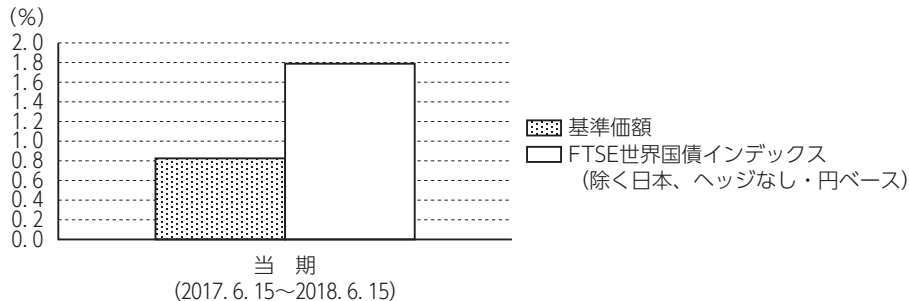
ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

ベンチマークとの差異について

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

当期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.03%程度でした。ただし、これらはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は120円といたしました。
収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2017年6月16日	～2018年6月15日
当期分配金（税込み）	(円)	120
対基準価額比率	(%)	1.18
当期の収益	(円)	120
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	151

(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。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	206.11円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	0.00
(d) 分配準備積立金	65.43
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	271.54
(f) 分配金	120.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	151.54

(注) 下線を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 6. 16～2018. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	42円	0. 410%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10, 353円です。
(投 信 会 社)	(29)	(0. 281)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(11)	(0. 108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0. 022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	6	0. 059	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0. 023)	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)	(4)	(0. 035)	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	49	0. 469	

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

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券 インデックス マザーファンド	—	—	6	16

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■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

期首保有額	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

(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	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	375	369	1,001

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス マザーファンド	1,001	98.5
コール・ローン等、その他	15	1.5
投資信託財産総額	1,016	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,016,950円
コール・ローン等	15,109
外国債券インデックス マザーファンド（評価額）	1,001,841
(B) 負債	14,190
未払収益分配金	12,000
未払信託報酬	2,008
その他未払費用	182
(C) 純資産総額（A－B）	1,002,760
元本	1,000,000
次期繰越損益金	2,760
(D) 受益権総口数	1,000,000口
1万口当り基準価額（C／D）	10,028円

* 期首における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は0円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,028円です。

■損益の状況

当期 自 2017年 6月16日 至 2018年 6月15日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	12,605円
売買益	12,605
(B) 信託報酬等	△ 4,388
(C) 当期損益金 (A + B)	8,217
(D) 前期繰越損益金	6,543
(E) 合計 (C + D)	14,760
(F) 収益分配金	△ 12,000
次期繰越損益金 (E + F)	2,760
分配準備積立金	15,154
繰越損益金	△ 12,394

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

(注2) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	20,611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	6,543
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	27,154
(f) 分配金	12,000
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	15,154
(h) 受益権総口数	1,000,000口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	120円

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

《お知らせ》

■運用において参照している指数の名称変更について

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

外国債券インデックスマザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用））が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2017年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年6月15日）現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を251～269ページに併せて掲載いたしました。

■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2028/2/15	668,168	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.875% 2018/5/31	439,788
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2027/8/15	663,832	United Kingdom Gilt (イギリス) 1.25% 2018/7/22	410,942
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2027/11/15	590,244	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4.25% 2019/4/25	408,061
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2019/6/30	440,296	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2018/10/31	406,508
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2047/8/15	412,429	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2018/8/31	390,206
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.375% 2027/5/15	411,368	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1% 2018/5/31	375,037
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2020/11/15	405,018	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア) 4.5% 2019/3/1	369,211
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2024/10/31	394,123	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 4% 2018/8/15	366,817
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2022/11/30	388,154	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 3.75% 2019/1/4	366,384
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3% 2048/2/15	380,685	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4.25% 2018/10/25	357,139

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

■組入資産明細表

下記は、2018年6月15日現在における外国債券インデックスマザーファンド（60,439,178千口）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2018年6月15日現在							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちB格以下組入率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 661,524	千アメリカ・ドル 649,694	千円 71,908,195	% 43.8	% —	% 18.3	% 17.3	% 8.3
カナダ	千カナダ・ドル 38,138	千カナダ・ドル 40,123	3,383,654	2.1	—	0.9	0.6	0.6
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 39,919	千オーストラリア・ドル 42,073	3,472,316	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,987	千シンガポール・ドル 8,089	664,963	0.4	—	0.2	0.1	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 62,191	千イギリス・ポンド 77,882	11,422,208	7.0	—	5.2	1.3	0.5
スイス	千スイス・フラン 1,590	千スイス・フラン 1,921	213,101	0.1	—	0.0	0.1	—
デンマーク	千デンマーク・クローネ 45,172	千デンマーク・クローネ 55,798	958,060	0.6	—	0.4	0.1	0.1

作成期		2018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
ノルウェー		千ノルウェー・クローネ 27,302	千ノルウェー・クローネ 28,345	千円 385,492	% 0.2	% —	% 0.1	% 0.1	% —
スウェーデン		千スウェーデン・クローネ 44,065	千スウェーデン・クローネ 50,078	632,992	0.4	—	0.2	0.2	—
メキシコ		千メキシコ・ペソ 227,035	千メキシコ・ペソ 225,599	1,197,930	0.7	—	0.4	0.2	0.1
マレーシア		千マレーシア・リンギット 29,271	千マレーシア・リンギット 28,925	803,553	0.5	—	0.3	0.1	0.1
南アフリカ		千南アフリカ・ランド 124,745	千南アフリカ・ランド 113,279	931,156	0.6	—	0.5	0.0	0.0
ポーランド		千ポーランド・ズロチ 33,567	千ポーランド・ズロチ 34,455	1,028,153	0.6	—	0.2	0.3	0.1
ユーロ圏	アイルランド	千ユーロ 9,627	千ユーロ 10,632	1,359,894	0.8	—	0.5	0.2	0.2
	オランダ	千ユーロ 23,580	千ユーロ 27,544	3,522,916	2.1	—	1.4	0.6	0.2
	ベルギー	千ユーロ 26,664	千ユーロ 31,792	4,066,199	2.5	—	1.9	0.5	0.1
	フランス	千ユーロ 109,971	千ユーロ 128,579	16,445,302	10.0	—	6.3	2.6	1.1
	ドイツ	千ユーロ 77,343	千ユーロ 90,004	11,511,621	7.0	—	4.0	2.2	0.8
	スペイン	千ユーロ 64,410	千ユーロ 75,330	9,634,728	5.9	—	3.9	1.3	0.6
	イタリア	千ユーロ 107,296	千ユーロ 115,409	14,760,877	9.0	—	5.2	2.8	1.0
	フィンランド	千ユーロ 7,233	千ユーロ 7,892	1,009,467	0.6	—	0.3	0.2	0.1
	オーストリア	千ユーロ 16,658	千ユーロ 19,299	2,468,421	1.5	—	1.0	0.4	0.1
	小計	千ユーロ 442,782	千ユーロ 506,484	64,779,431	39.5	—	24.7	10.7	4.1
合計		—	—	161,781,211	98.6	—	52.7	31.7	14.2

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

(注 2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注 3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

外国債券インデックスマザーファンド

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

2018年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	2,621	2,656	294,046	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,020	4,069	450,370	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,280	4,356	482,128	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,073	3,125	345,976	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,854	2,854	315,940	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,509	4,507	498,841	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,076	4,176	462,247	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,582	285,783	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,488	275,434	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,101	232,577	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,139	347,436	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,365	261,806	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,385	2,357	260,928	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,368	1,348	149,285	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,784	1,753	194,088	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,426	268,571	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,872	1,839	203,631	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,215	2,173	240,576	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	884	869	96,215	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,168	3,014	333,607	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,353	1,323	146,497	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,894	1,854	205,213	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,366	1,341	148,429	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,197	464,529	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,968	1,925	213,102	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,160	1,130	125,173	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,455	493,174	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,451	1,412	156,381	2020/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,461	2,404	266,126	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,131	2,101	232,540	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,827	2,792	309,028	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,768	2,723	301,478	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,993	1,972	218,291	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,885	1,858	205,746	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,345	2,297	254,270	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	4,997	553,117	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,501	2,462	272,547	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,006	1,992	220,514	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,199	575,441	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,647	1,624	179,810	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,734	1,703	188,573	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,821	2,788	308,640	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,912	3,831	424,117	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,407	2,378	263,241	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,241	2,223	246,084	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,732	2,678	296,436	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,885	2,862	316,853	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,485	3,426	379,270	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.1250	724	771	85,368	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.7500	642	724	80,168	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,464	272,824	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	761	84,288	2023/08/15

2018年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,036	114,754	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.5000	630	797	88,315	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	893	98,941	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	856	94,744	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	889	98,445	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	473	571	63,304	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	964	1,280	141,771	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	991	1,242	137,489	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,626	1,965	217,574	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	547	706	78,160	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	659	73,043	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	635	70,344	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,249	1,343	148,681	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,335	147,829	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	760	935	103,574	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,467	162,422	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,710	2,144	237,405	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,478	1,795	198,767	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,591	1,806	199,932	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,757	194,547	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,754	2,244	248,474	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,665	184,362	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,367	1,526	168,969	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,468	162,554	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,643	181,934	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,341	148,486	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,731	1,641	181,662	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,630	2,492	275,849	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,326	2,353	260,456	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,798	3,675	406,831	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,064	3,366	372,557	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	3,581	4,014	444,275	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,617	3,977	440,266	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,657	3,861	427,362	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,326	3,296	364,871	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,795	309,354	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,162	5,013	554,858	2024/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,729	3,771	417,397	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,989	2,959	327,550	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,272	140,799	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,404	3,372	373,250	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,555	393,563	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,190	3,147	348,362	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,111	233,731	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,697	630,551	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,696	3,654	404,471	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,804	310,350	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,325	4,262	471,788	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,102	343,344	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,204	2,174	240,621	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,963	3,882	429,747	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,427	2,321	256,991	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,429	600,923	2025/02/15

外国債券インデックスマザーファンド

2018年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,763	3,376	373,698	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,788	2,733	302,499	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,809	1,744	193,086	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,792	2,734	302,643	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,785	308,274	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,503	609,129	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,835	3,791	419,614	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,607	2,550	282,275	2020/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,513	278,208	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,730	302,247	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,013	2,951	326,625	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,001	2,943	325,816	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,750	304,422	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,135	3,072	340,014	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,112	233,784	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,403	598,037	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,573	3,448	381,646	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,355	260,759	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,868	2,792	309,021	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,367	262,035	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,876	2,796	309,511	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,577	617,329	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,116	3,025	334,880	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	3,665	405,700	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,461	272,411	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,021	334,389	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,078	672,736	2022/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	2,975	329,352	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,492	2,419	267,840	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,126	3,024	334,713	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,366	4,883	540,546	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,444	270,517	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,428	3,067	339,542	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,309	3,175	351,502	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,262	4,016	444,556	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,887	319,539	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	1,998	221,204	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,029	5,473	605,825	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,361	261,376	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	1,957	216,685	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	3,060	338,721	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,598	287,629	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,362	261,437	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,100	2,069	229,039	2019/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,385	264,029	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,796	309,494	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,456	271,846	2019/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,600	5,016	555,254	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	2,946	326,155	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,451	271,370	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,519	389,486	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,525	390,158	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,570	284,539	2023/07/31

2018年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,230	246,891	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,600	2,549	282,156	2019/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,324	257,324	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	2,888	319,719	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,147	2,105	232,996	2019/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,500	5,114	566,079	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,857	316,214	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,348	259,879	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,650	3,516	389,176	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,400	1,370	151,736	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,398	265,492	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,400	2,321	256,913	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,440	1,415	156,708	2019/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,949	215,737	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,422	268,094	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,500	1,473	163,054	2020/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,340	5,057	559,765	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,918	322,995	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,401	265,757	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,875	3,827	423,656	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,130	2,089	231,262	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,915	322,735	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,210	244,658	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,900	1,869	206,948	2020/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,550	2,448	271,009	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,806	310,639	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	850	833	92,295	2020/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,700	5,446	602,827	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,500	3,456	382,564	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	2,900	321,066	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	2,858	316,397	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	3,920	433,878	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,884	319,276	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,958	438,133	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,904	210,741	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,700	2,643	292,590	2020/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,953	437,615	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,881	318,964	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,282	252,661	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,000	1,955	216,472	2020/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	988	109,403	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,569	616,482	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,300	1,269	140,561	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,797	309,609	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,872	317,928	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,800	3,566	394,789	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,100	2,003	221,694	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	600	591	65,466	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,886	208,804	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,500	2,432	269,229	2020/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,407	266,473	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	985	109,127	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,250	359,758	2024/09/30

外国債券インデックスマザーファンド

2018年6月15日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日	
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,000	977	108,176	2020/10/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,418	267,640	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,186	574,017	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,100	2,909	322,037	2047/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,369	372,911	2024/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,600	3,525	390,180	2020/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,800	2,769	306,526	2019/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,962	217,216	2020/12/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,055	338,153	2024/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	1,000	990	109,594	2019/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,300	1,249	138,341	2024/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,300	2,262	250,376	2021/01/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,300	2,280	252,405	2020/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,433	380,054	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,300	6,195	685,730	2028/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,800	1,791	198,265	2020/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,473	273,725	2021/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,273	362,358	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,538	280,933	2025/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,675	296,101	2025/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,600	3,553	393,308	2048/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,200	3,174	351,339	2021/03/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,500	1,491	165,105	2020/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	2,859	316,507	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	2,849	315,428	2025/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,500	2,478	274,353	2021/04/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,200	1,213	134,340	2048/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,400	1,391	154,031	2028/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,000	2,994	331,402	2021/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,200	1,195	132,343	2020/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,492	275,878	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,896	209,896	2025/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,400	1,398	154,739	2020/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,896	209,896	2025/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,492	275,878	2023/05/31	
通貨小計	銘柄数	246銘柄						
	金 額			661,524	649,694	71,908,195		
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	425	484	40,832	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	386	564	47,596	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,310	110,536	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,614	136,140	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,112	1,566	132,123	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,524	1,553	130,965	2019/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	1,767	149,015	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,876	1,931	162,896	2020/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	989	83,404	2021/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,794	151,329	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,561	1,935	163,212	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,214	102,459	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,428	120,478	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,627	1,625	137,114	2019/09/01	

2018年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,197	1,314	110,845	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,157	97,614	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,719	1,707	143,976	2020/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,831	1,783	150,390	2020/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,129	1,067	90,047	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,237	1,196	100,875	2021/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,480	1,420	119,776	2021/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,113	93,875	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	840	792	66,868	2022/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,337	112,815	2022/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,360	1,344	113,399	2019/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	500	495	41,826	2019/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	585	49,360	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,600	1,572	132,573	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,600	1,583	133,526	2020/02/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	700	697	58,836	2020/05/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	595	50,178	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	279	23,571	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	300	298	25,188	2020/08/01
通貨小計	銘柄数	33銘柄					
	金 額			38,138	40,123	3,383,654	
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,665	220,008	2021/05/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,409	2,514	207,554	2020/04/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,162	2,455	202,646	2022/07/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,364	195,119	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,008	248,301	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,473	2,509	207,111	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,074	2,174	179,426	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,398	2,500	206,327	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,358	1,617	133,476	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,848	3,171	261,763	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,011	2,030	167,605	2019/10/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,222	100,856	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	557	536	44,313	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,195	2,177	179,682	2020/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	712	725	59,881	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,522	2,529	208,800	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,978	1,897	156,561	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,132	1,082	89,341	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	1,787	147,545	2021/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,200	2,203	181,865	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	299	24,689	2022/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	600	599	49,437	2029/11/21
通貨小計	銘柄数	22銘柄					
	金 額			39,919	42,073	3,472,316	
シンガポール				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	696	715	58,778	2020/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	830	68,293	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	455	37,450	2022/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.5000	599	603	49,577	2019/06/01

外国債券インデックスマザーファンド

2018年6月15日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日	
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
			%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	623	644	53,013	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	359	365	30,026	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	495	497	40,900	2021/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	386	31,794	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	491	501	41,257	2023/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	368	391	32,197	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	125	128	10,526	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	415	413	34,030	2019/10/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	124	123	10,152	2025/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	224	224	18,431	2020/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	568	547	44,972	2046/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	250	243	20,046	2026/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	190	184	15,204	2021/10/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	197	16,206	2022/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	150	136	11,218	2036/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	196	16,128	2023/02/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	300	301	24,755	2028/05/01	
通貨小計	銘柄数	21銘柄						
	金 額			7,987	8,089	664,963		
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド			
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,280	2,340	343,309	2020/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,821	1,926	282,520	2025/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,524	370,277	2021/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,582	2,075	304,405	2065/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,491	218,732	2026/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,300	1,278	187,447	2022/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	910	857	125,759	2047/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	400	399	58,587	2037/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,130	1,173	172,073	2057/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,210	1,197	175,575	2027/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	1,000	985	144,460	2023/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	500	507	74,400	2028/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	430	442	64,936	2071/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,337	196,131	2021/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,372	201,282	2028/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,340	1,783	261,593	2032/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,839	269,843	2025/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,032	2,822	413,940	2036/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,457	2,215	324,948	2038/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,724	1,845	270,715	2020/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,958	433,857	2055/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,086	3,243	475,633	2046/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,551	227,585	2027/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,596	2,461	360,981	2042/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,480	2,019	296,195	2030/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,523	2,454	359,972	2049/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,246	1,798	263,728	2039/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,543	226,331	2022/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,620	2,269	332,814	2034/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,428	1,482	217,460	2019/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,244	2,151	315,593	2060/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,795	1,916	281,061	2020/09/07	

2018年6月15日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日	
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,307	338,413	2040/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	803	878	128,841	2021/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,352	2,077	304,663	2052/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,318	340,017	2022/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,966	2,557	375,121	2044/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,942	2,061	302,318	2023/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,621	2,709	397,399	2068/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,251	2,278	334,195	2019/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,392	1,527	224,092	2024/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	2,897	424,987	2045/01/22	
通貨小計	銘柄数	42銘柄						
	金 額			62,191	77,882	11,422,208		
スイス	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	千スイス・フラン 404	千スイス・フラン 489	54,340	2023/02/11	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	497	692	76,836	2028/04/08	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	327	347	38,583	2020/07/06	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	362	390	43,341	2021/04/28	
合 計	銘柄数	4銘柄						
	金 額			1,590	1,921	213,101		
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 11,512	千デンマーク・クローネ 19,496	334,762	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	8,601	9,168	157,418	2019/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	5,550	6,199	106,453	2021/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,256	90,260	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	8,363	9,322	160,072	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,800	4,824	82,837	2027/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,529	26,254	2020/11/15	
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金 額			45,172	55,798	958,060		
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	千ノルウェー・クローネ 6,998	千ノルウェー・クローネ 7,532	102,442	2021/05/25	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	6,024	6,198	84,305	2023/05/24	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,434	60,315	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,428	46,630	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,300	44,883	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,450	3,449	46,914	2027/02/17	
通貨小計	銘柄数	6銘柄						
	金 額			27,302	28,345	385,492		
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	千スウェーデン・クローネ 9,095	千スウェーデン・クローネ 10,355	130,887	2020/12/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	5,876	74,276	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	9,738	123,096	2022/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,609	96,187	2023/11/13	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,095	5,908	74,679	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,680	5,965	75,399	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,550	4,625	58,466	2028/05/12	
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金 額			44,065	50,078	632,992		

外国債券インデックスマザーファンド

2018年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.0000	千メキシコ・ペソ 21,447	千メキシコ・ペソ 20,594	千円 109,358	2019/12/11
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	13,290	11,611	61,657	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	7,000	6,977	37,052	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	10,000	9,788	51,977	2021/12/09
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	10,633	10,644	56,522	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	22,119	24,436	129,759	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	14,668	14,255	75,695	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,874	8,198	43,533	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	8,844	9,200	48,857	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	9,694	10,171	54,012	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	18,928	18,995	100,868	2020/06/11
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	27,826	26,794	142,278	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	12,786	67,895	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	17,099	16,231	86,190	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	18,654	18,117	96,202	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	6,944	6,792	36,068	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	16銘柄					
	金 額			227,035	225,599	1,197,930	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7340	千マレーシア・リンギット 647	千マレーシア・リンギット 663	18,425	2019/07/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	573	535	14,868	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.2480	738	784	21,789	2028/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	1,603	1,622	45,085	2019/11/29
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,165	32,377	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,916	1,941	53,937	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,520	42,235	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,241	34,496	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	858	23,856	2022/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	706	19,619	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1270	618	580	16,134	2032/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,044	1,043	28,986	2020/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	980	27,236	2023/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	927	836	23,232	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	586	563	15,644	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8890	656	660	18,336	2020/07/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	603	16,773	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,060	29,465	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	857	865	24,030	2021/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6540	648	649	18,056	2019/10/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	737	723	20,093	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	700	701	19,496	2020/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,155	32,112	2022/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	820	766	21,294	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	702	696	19,344	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	900	25,004	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	630	17,506	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	351	9,770	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	500	501	13,929	2022/03/10
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750	747	20,763	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	350	338	9,414	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	850	841	23,387	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,187	32,997	2025/03/14

2018年6月15日現在								
区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570%	千マレーシア・リンギット 500	千マレーシア・リンギット 498	千円 13,848	2023/04/20
通貨小計	銘柄数	34銘柄						
	金 額				29,271	28,925	803,553	
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	千南アフリカ・ランド 5,768	千南アフリカ・ランド 5,746	47,237	2020/01/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	16,434	17,940	147,475	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	7,612	5,440	44,724	2036/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	4,622	4,491	36,919	2021/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	8,904	6,250	51,377	2041/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	8,999	7,413	60,941	2031/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	5,539	5,420	44,560	2023/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	15,452	13,863	113,956	2048/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	11,021	9,905	81,421	2037/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	8,862	8,020	65,924	2030/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	11,944	10,751	88,373	2044/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	8,243	7,449	61,234	2032/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	6,166	5,771	47,443	2035/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	5,179	4,813	39,564	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金 額				124,745	113,279	931,156	
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 2,309	千ポーランド・ズロチ 2,630	78,503	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	5.5000	1,912	2,018	60,228	2019/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.5000	2,478	2,476	73,912	2020/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,377	3,233	96,481	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,127	2,137	63,780	2021/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.7500	3,051	3,036	90,613	2021/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,370	2,245	67,007	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,320	2,325	69,381	2022/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,700	1,707	50,956	2023/01/25
		Poland Government Bond	国債証券	—	300	289	8,652	2020/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,023	30,541	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.2500	2,256	2,443	72,919	2020/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,084	1,215	36,271	2021/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,225	2,383	71,111	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	800	771	23,016	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,840	1,878	56,054	2019/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,591	2,638	78,720	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	17銘柄						
	金 額				33,567	34,455	1,028,153	
ユーロ (アイルランド)		IRISH TREASURY	国債証券	4.4000	千ユーロ 684	千ユーロ 717	91,739	2019/06/18
		IRISH TREASURY	国債証券	5.9000	570	618	79,138	2019/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,131	1,502	192,162	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	765	863	110,486	2020/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	504	597	76,421	2023/03/20
		IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	717	91,805	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	761	866	110,864	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	534	68,394	2022/03/15

外国債券インデックスマザーファンド

2018年 6月15日現在								
区 分		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	千ユーロ 681	千ユーロ 713	千円 91,270	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,101	140,891	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	350	357	45,709	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	—	50	50	6,408	2022/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	500	498	63,760	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	700	688	88,111	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	4.5000	735	803	102,729	2020/04/18
国小計	銘柄数	15銘柄						
	金 額				9,627	10,632	1,359,894	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	743	95,060	2023/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,239	1,823	233,247	2028/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,355	2,061	263,715	2037/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	935	119,703	2023/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,147	1,205	154,127	2019/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,146	1,245	159,278	2020/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,349	2,110	269,951	2042/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,463	1,633	208,877	2021/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,589	203,296	2022/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,432	183,190	2033/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,517	194,040	2023/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,084	1,506	192,650	2047/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,692	216,420	2024/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,374	1,393	178,279	2020/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,291	1,293	165,445	2025/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,338	1,354	173,202	2026/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,215	155,469	2022/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,200	1,229	157,224	2027/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	799	102,253	2024/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	750	762	97,480	2028/07/15	
国小計	銘柄数	20銘柄						
	金 額				23,580	27,544	3,522,916	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,443	184,623	2025/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	924	919	117,565	2031/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	558	601	76,965	2038/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,283	1,333	170,497	2026/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,044	1,019	130,436	2047/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	340	359	45,932	2066/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	150	151	19,356	2023/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,400	1,417	181,359	2027/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	650	660	84,509	2024/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	260	285	36,531	2057/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	300	303	38,762	2037/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	600	600	76,865	2028/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	300	302	38,714	2033/04/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,491	318,627	2028/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,672	341,756	2035/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	877	1,021	130,639	2022/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	1,736	1,907	243,922	2020/09/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,674	2,562	327,806	2041/03/28	

2018年 6月15日現在								
区 分		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	千ユーロ 1,446	千ユーロ 1,668	千円 213,437	2021/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,314	168,177	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,570	200,926	2022/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	680	939	120,099	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	1,123	1,174	150,184	2019/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,494	191,205	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	753	1,100	140,716	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,724	220,598	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	597	750	95,982	2034/06/22
国小計	銘柄数	27銘柄						
	金 額				26,664	31,792	4,066,199	
ユーロ (フランス)		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	千ユーロ 653	千ユーロ 733	93,827	2019/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	985	1,398	178,891	2023/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	4,295	549,359	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,623	3,923	501,820	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,807	4,595	587,718	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,209	3,435	439,381	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,364	2,197	281,095	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,230	3,618	462,835	2021/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,824	4,188	535,669	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,697	4,546	581,553	2023/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,084	4,947	632,778	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,263	3,453	441,722	2019/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,380	3,633	464,716	2020/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,167	1,925	246,262	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,916	500,874	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,113	3,333	426,369	2020/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,550	3,983	509,488	2021/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,630	4,093	523,574	2022/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,499	4,185	535,276	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	2,982	381,448	2022/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,238	3,070	392,695	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,650	466,908	2023/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,086	3,479	445,066	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,787	3,299	421,952	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,399	3,740	478,405	2024/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,322	2,358	301,590	2019/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,292	3,345	427,935	2025/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,070	3,101	396,689	2020/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,101	2,203	281,834	2025/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,193	2,232	285,583	2020/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,420	3,639	465,504	2031/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,737	2,754	352,337	2026/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,009	2,002	256,077	2036/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	787	763	97,601	2066/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,770	2,803	358,559	2021/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,800	2,743	350,850	2026/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,019	258,265	2022/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	620	661	84,597	2039/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	706	90,360	2020/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,591	331,475	2027/05/25

外国債券インデックスマザーファンド

2018年6月15日現在								
区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,700	1,834	234,622	2048/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,706	218,312	2023/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,600	2,610	333,856	2028/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,416	181,126	2021/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	450	456	58,429	2034/05/25
国小計	銘柄数	45銘柄						
	金 額				109,971	128,579	16,445,302	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ドイツ）		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,319	168,723	2024/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,567	2,434	311,325	2027/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,035	260,292	2028/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,250	1,783	228,157	2028/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,564	200,049	2030/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,308	295,264	2031/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	2,835	362,659	2034/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,071	3,176	406,269	2037/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	1,997	255,432	2039/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,399	2,452	313,666	2040/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,481	2,590	331,345	2019/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,075	2,203	281,793	2020/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,928	2,072	265,085	2020/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,474	2,175	278,286	2042/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,444	1,536	196,564	2020/09/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,518	322,115	2021/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,867	238,900	2021/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,540	197,002	2021/09/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,807	3,051	390,242	2022/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,414	308,765	2022/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,828	2,416	309,110	2044/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,772	226,641	2022/09/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,526	195,251	2023/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,971	252,096	2023/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,779	227,560	2023/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,724	220,517	2024/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,959	2,616	334,667	2046/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,740	222,608	2024/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,638	209,556	2024/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,259	289,047	2025/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,270	290,360	2025/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,168	2,221	284,158	2026/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	2,793	357,308	2026/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,592	203,690	2027/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,328	297,797	2027/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	800	819	104,759	2048/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,208	154,515	2028/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	402	51,509	2019/06/14
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,901	2019/09/13
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,010	129,205	2019/12/13
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	707	90,540	2020/03/13
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	810	103,610	2020/06/12
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,151	1,165	149,061	2019/10/11
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,731	1,752	224,093	2020/04/17

2018年 6月15日現在								
区 分		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	千ユーロ 1,448	千ユーロ 1,477	千円 188,917	2020/10/16
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,578	1,602	204,916	2021/04/09
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,421	181,873	2021/10/08
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	360	365	46,734	2022/04/08
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	2,127	272,076	2022/10/07
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	504	64,587	2023/04/14
国小計	銘柄数	50銘柄						
	金 額				77,343	90,004	11,511,621	
ユーロ (スペイン)		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	千ユーロ 1,952	千ユーロ 2,827	361,573	2029/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,745	1,841	235,541	2025/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,552	1,609	205,914	2030/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,792	1,947	249,148	2025/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1500	1,650	1,697	217,087	2020/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,853	237,019	2026/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,747	1,792	229,248	2021/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,052	1,149	147,057	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	850	1,002	128,218	2066/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,730	1,757	224,847	2026/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	1,380	1,395	178,507	2022/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,843	235,812	2027/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,450	1,535	196,363	2033/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,800	1,826	233,670	2027/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	300	301	38,513	2021/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,000	1,010	129,280	2022/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,100	2,108	269,658	2028/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	650	677	86,631	2048/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	700	697	89,247	2023/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	2,980	381,194	2032/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,654	2,216	283,491	2037/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,608	2,368	302,884	2040/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	2,078	265,869	2024/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6000	1,882	1,987	254,182	2019/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3000	1,775	1,888	241,599	2019/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,373	1,979	253,147	2041/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,101	2,267	290,000	2020/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	1,789	2,260	289,153	2025/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,681	1,879	240,410	2020/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,515	2,918	373,338	2021/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,703	345,760	2026/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,393	306,131	2022/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,608	3,222	412,157	2023/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,601	1,935	247,554	2023/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,404	307,582	2028/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,499	2,311	295,681	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,333	298,467	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,369	303,048	2024/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	1,952	249,729	2020/01/31
		国小計	銘柄数	39銘柄				
金 額					64,410	75,330	9,634,728	

外国債券インデックスマザーファンド

2018年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ (イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,500	191,950	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,499	191,723	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,129	400,217	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,848	236,476	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0500	1,445	1,453	185,944	2019/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,429	1,386	177,384	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,620	207,269	2022/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,598	204,456	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,765	1,512	193,457	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,511	1,509	193,019	2020/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,591	1,549	198,163	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,493	191,061	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	774	769	98,368	2020/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,440	1,267	162,106	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,359	2,272	290,688	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,286	1,206	154,307	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,674	1,644	210,325	2021/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	924	814	104,122	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,568	1,422	181,996	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	700	656	84,010	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,320	168,868	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	648	550	70,388	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	858	852	109,040	2019/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	700	645	82,582	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	2,010	1,939	248,034	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	295	37,828	2024/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	350	346	44,339	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	970	961	123,009	2020/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,450	1,432	183,210	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,000	947	121,245	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	700	681	87,136	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	700	668	85,557	2024/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	1,900	1,868	239,002	2020/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	800	759	97,119	2038/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	563	72,028	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	900	867	110,967	2023/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	900	849	108,711	2025/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	500	485	62,127	2021/04/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,454	2,989	382,330	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,721	475,998	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,655	2,153	275,403	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,921	2,037	260,639	2020/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,498	3,071	392,824	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,790	3,089	395,165	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	2,945	376,747	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,034	2,506	320,625	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,565	328,125	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,531	2,644	338,197	2019/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,472	316,220	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,043	2,516	321,921	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,560	2,712	346,935	2020/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,214	2,363	302,264	2020/09/01

2018年 6月15日現在								
区 分		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	千ユーロ 2,070	千ユーロ 2,363	千円 302,231	2026/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,296	293,750	2021/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,532	323,965	2021/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,265	289,758	2022/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	1,912	244,645	2022/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,910	2,211	282,793	2022/11/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,810	2,105	269,339	2028/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,129	272,421	2023/05/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,613	1,947	249,087	2044/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,477	316,839	2024/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,729	1,856	237,450	2021/05/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,394	306,294	2024/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,938	2,030	259,755	2030/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,638	209,598	2021/12/15
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	1.5000	1,246	1,261	161,293	2019/08/01
国小計	銘柄数	67銘柄						
	金 額				107,296	115,409	14,760,877	
ユーロ (フィンランド)		Finland Government Bond	国債証券	0.3750	千ユーロ 432	千ユーロ 440	56,384	2020/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	407	52,156	2031/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	290	37,127	2025/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	411	414	52,954	2026/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	—	200	200	25,601	2023/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	—	270	272	34,884	2022/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	297	38,046	2027/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.1250	370	374	47,871	2034/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	4.3750	416	437	56,014	2019/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	840	107,528	2025/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	3.3750	632	677	86,712	2020/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	3.5000	459	510	65,300	2021/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	468	59,966	2028/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	1.6250	612	660	84,445	2022/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	480	61,477	2023/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	529	67,762	2042/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	588	75,231	2024/04/15
国小計	銘柄数	17銘柄						
	金 額				7,233	7,892	1,009,467	
ユーロ (オーストリア)		Austria Government Bond	国債証券	0.2500	千ユーロ 527	千ユーロ 532	68,125	2019/10/18
		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	926	118,538	2025/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,148	146,907	2026/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	734	733	93,810	2047/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	150	132	16,999	2086/11/02
		Austria Government Bond	国債証券	—	900	901	115,283	2023/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	580	575	73,670	2027/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	250	270	34,591	2117/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	403	51,627	2022/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	500	502	64,279	2028/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,243	159,105	2027/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.9000	1,248	1,363	174,438	2020/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,507	192,868	2021/09/15

外国債券インデックスマザーファンド

2018年6月15日現在								
区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500%	1,073千ユーロ	1,603千ユーロ	205,027千円	2037/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,178	150,739	2026/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	917	117,399	2022/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	1,011	129,415	2022/11/22
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	318	534	68,334	2062/01/26
		Austria Government Bond	国債証券	1.9500	138	141	18,092	2019/06/18
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	860	110,068	2044/06/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,049	134,255	2023/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	621	738	94,453	2034/05/23
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,019	130,388	2024/10/21
国小計	銘柄数	23銘柄						
	金 額				16,658	19,299	2,468,421	
通貨小計	銘柄数	303銘柄						
	金 額				442,782	506,484	64,779,431	
合 計	銘柄数	772銘柄						
	金 額						161,781,211	

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第18期（決算日 2017年11月30日）

（計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

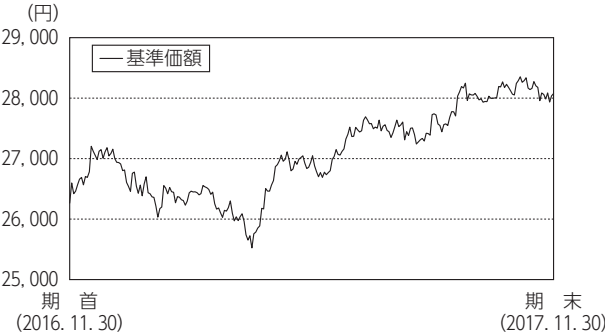
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



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

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について
【基準価額・騰落率】
期首：26,265円 期末：28,075円 騰落率：6.9%
【基準価額の主な変動要因】
主に日本を除く先進国国債に投資した結果、債券市場で金利は上昇 (債券価格は下落) したものの、ユーロなどの対円為替レートの上昇がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。
◆投資環境について
○海外債券市況
主要国の国債金利は、期を通じて多くの国で上昇しました。期首より、上下に振れながらもおおむねレンジ内で推移しましたが、2017年3月中旬以降は、米国トランプ政権の政策に対する不透明感などから金利は低下基調となりました。6月下旬以降は、ECB (欧州中央銀行) やBOC (カナダ銀行) などが金融緩和姿勢を後退させる中で、ドイツやカナダなどを中心に金利が上昇しました。しかしその後、米国の政治動向の不透明感や地政学リスクの高まりなどから、金利は低下基調で推移しました。9月には、米国の2017年中の追加利上げ観測の高まりなどを背景に金利は上昇しましたが、その後は、金利はレンジ内での推移が続きました。
○為替相場
為替相場は、期を通じてユーロなどの欧州の通貨が対円で上昇しました。期首より、米国の利上げ観測などを受けて円安となりましたが、2017年に入ると、トランプ政権に対する期待感の後退や欧州の政治情勢の不透明感などから円高傾向となりました。4月半ばからは、フランス大統領選挙の結果を受けて、ユーロが上昇傾向となった一方で円は下落傾向となりました。5月にはいったん円高となる場面も見られましたが、6月中旬に入り先進各国の中央銀行が金融緩和姿勢を後退させる中で内外の金利差が拡大傾向となったことなどから、円は下落傾向となりました。7月以降は、地政学リスクの高まりなどから円高傾向となりました。9月以降は、米国の2017年中の追加利上げ観測の高まりなどを背景に円安が進んだ後、米国の低インフレへの懸念などから円高に転じました。

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

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

◆ベンチマークとの差異について
ベンチマーク (シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)) の騰落率は6.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は6.9%となりました。
当期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー (両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの) は0.05%程度でした。ただし、これらはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

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

(注 2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況
公 社 債

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

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

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

(注 1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

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

(注 3) 単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

■主要な売買銘柄
公 社 債

(2016年12月 1 日から2017年11月30日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注 2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国 (外貨建) 公社債 (通貨別)

作 成 期	当			期		未		
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちＢＢ格 以下組入 比	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5 年以上	2 年以上	2 年未満
			千円	%	%	%	%	%
アメリカ	千アメリカ・ドル 626,026	千アメリカ・ドル 632,164	70,834,003	42.5	—	17.7	16.6	8.2
カナダ	千カナダ・ドル 37,381	千カナダ・ドル 40,103	3,492,978	2.1	—	0.9	0.7	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 38,134	千オーストラリア・ドル 41,065	3,485,224	2.1	—	1.3	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,117	千シンガポール・ドル 7,446	619,502	0.4	—	0.2	0.1	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 60,444	千イギリス・ポンド 75,999	11,425,072	6.9	—	5.0	1.5	0.4
スイス	千スイス・フラン 2,187	千スイス・フラン 2,587	294,510	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 48,636	千デンマーク・クローネ 60,118	1,072,508	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 32,577	千ノルウェー・クローネ 34,557	469,287	0.3	—	0.2	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 50,850	千スウェーデン・クローネ 57,615	770,894	0.5	—	0.2	0.2	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 225,127	千メキシコ・ペソ 231,806	1,397,790	0.8	—	0.5	0.3	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 26,889	千マレーシア・リンギット 26,874	736,885	0.4	—	0.2	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 116,723	千南アフリカ・ランド 102,959	844,266	0.5	—	0.4	0.0	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 31,917	千ポーランド・ズロチ 32,731	1,034,302	0.6	—	0.2	0.3	0.1

作 成 期		当 期				末			
区 分		額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちＢＢ格 以下組入 比	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	アイルランド	千ユーロ 8,727	千ユーロ 9,950	千円 1,321,550	% 0.8	% —	% 0.5	% 0.2	% 0.1
	オランダ	千ユーロ 23,054	千ユーロ 27,284	3,623,622	2.2	—	1.4	0.6	0.2
	ベルギー	千ユーロ 26,235	千ユーロ 32,088	4,261,666	2.6	—	1.8	0.5	0.2
	フランス	千ユーロ 108,392	千ユーロ 128,181	17,023,784	10.2	—	6.4	2.6	1.3
	ドイツ	千ユーロ 76,126	千ユーロ 89,437	11,878,234	7.1	—	4.1	2.1	0.9
	スペイン	千ユーロ 61,672	千ユーロ 71,965	9,557,727	5.7	—	3.7	1.3	0.7
	イタリア	千ユーロ 107,051	千ユーロ 123,182	16,359,857	9.8	—	5.7	3.0	1.1
	フィンランド	千ユーロ 6,863	千ユーロ 7,614	1,011,296	0.6	—	0.4	0.2	0.0
	オーストリア	千ユーロ 16,667	千ユーロ 19,652	2,610,004	1.6	—	1.0	0.4	0.2
	小計	434,787	509,357	67,647,744	40.6	—	24.9	10.9	4.8
合 計		—	—	164,124,972	98.4	—	52.3	31.4	14.8

(注 1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注 2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
(注 3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。
(注 4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

		当 期		末			
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	%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,488	2,537	284,300	2018/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,161	3,200	358,642	2019/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,096	3,159	353,990	2019/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	2,621	2,704	303,007	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,020	4,144	464,391	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,280	4,451	498,737	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,073	3,197	358,275	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,854	2,913	326,410	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,509	4,607	516,303	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,076	4,294	481,154	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,652	297,250	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,548	285,519	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,320	1,321	148,061	2018/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,154	241,448	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,165	2,159	241,933	2018/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,861	1,855	207,872	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,426	1,418	158,989	2019/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,223	361,191	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,843	1,835	205,675	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	300	299	33,521	2019/03/31
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	559	555	62,231	2019/04/30	

外国債券インデックスマザーファンド

当			期		未			償還年月日
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,429	272,194	2022/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,385	2,364	264,908	2019/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,368	1,352	151,570	2019/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,784	1,759	197,108	2019/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,494	279,509	2022/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,872	1,848	207,085	2019/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,215	2,185	244,845	2019/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	884	875	98,115	2019/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,168	3,099	347,331	2022/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,353	1,332	149,358	2019/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,894	1,868	209,419	2019/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,366	1,354	151,762	2020/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,323	484,444	2023/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,968	1,944	217,894	2020/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,160	1,142	127,997	2020/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,589	514,245	2023/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,451	1,427	159,992	2020/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,461	2,434	272,790	2020/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,131	2,133	239,103	2020/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,827	2,839	318,124	2020/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,768	2,817	315,653	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,993	2,008	225,006	2020/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,885	1,892	212,103	2020/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,611	3,598	403,188	2018/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,345	2,337	261,934	2020/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,179	580,403	2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,638	2,627	294,420	2018/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,501	2,510	281,307	2020/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,026	2,022	226,604	2018/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,006	2,035	228,107	2020/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,388	603,803	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,185	2,180	244,273	2019/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,647	1,658	185,843	2021/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,373	2,367	265,291	2019/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,734	1,738	194,840	2021/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,383	2,380	266,700	2019/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,821	2,850	319,377	2021/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	5,412	5,495	615,789	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,975	2,970	332,825	2019/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,407	2,430	272,379	2021/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,241	2,233	250,210	2019/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,732	2,736	306,668	2021/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,885	2,880	322,708	2019/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,485	3,504	392,688	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.8750	904	982	110,144	2019/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.1250	724	801	89,815	2019/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.7500	642	759	85,151	2020/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,588	290,049	2021/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	798	89,442	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,091	122,274	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.5000	630	842	94,371	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	944	105,829	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	904	101,379	2028/08/15	

当			期		未			償還年月日
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5. 2500	738	939	105, 291	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5. 2500	473	604	67, 717	2029/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6. 2500	964	1, 358	152, 192	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5. 3750	991	1, 318	147, 758	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 5000	1, 626	2, 088	234, 032	2036/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5. 0000	547	747	83, 772	2037/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 3750	548	696	78, 083	2038/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 5000	519	670	75, 118	2038/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 5000	849	961	107, 720	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 2500	1, 121	1, 405	157, 509	2039/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 5000	760	985	110, 412	2039/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 3750	1, 210	1, 543	172, 970	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 6250	1, 710	2, 254	252, 649	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 3750	1, 478	1, 888	211, 566	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 8750	1, 591	1, 898	212, 727	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 2500	1, 469	1, 848	207, 101	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 7500	1, 754	2, 360	264, 539	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 3750	1, 365	1, 750	196, 131	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 7500	1, 367	1, 603	179, 701	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 1250	1, 450	1, 541	172, 677	2041/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 1250	1, 623	1, 723	193, 150	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 0000	1, 353	1, 406	157, 596	2042/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 7500	1, 731	1, 719	192, 668	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 7500	2, 630	2, 609	292, 434	2042/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 1250	2, 026	2, 148	240, 686	2043/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 8750	3, 998	4, 054	454, 274	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 6250	3, 064	3, 531	395, 701	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 7500	3, 581	4, 214	472, 252	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 6250	3, 617	4, 175	467, 816	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 3750	3, 657	4, 050	453, 845	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 6250	3, 326	3, 318	371, 862	2019/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 2500	2, 834	2, 861	320, 674	2021/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 3750	5, 162	5, 199	582, 647	2024/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 1250	3, 729	3, 955	443, 259	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 6250	2, 989	2, 982	334, 143	2019/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 0000	1, 301	1, 301	145, 844	2021/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 7500	3, 404	3, 403	381, 357	2019/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 1250	3, 625	3, 642	408, 179	2021/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 5000	3, 190	3, 174	355, 663	2019/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 0000	2, 163	2, 163	242, 475	2021/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 2500	3, 921	3, 917	438, 970	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 0000	3, 696	3, 832	429, 472	2044/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 8750	2, 886	2, 873	321, 998	2021/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 5000	4, 325	4, 302	482, 096	2019/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 1250	3, 169	3, 183	356, 719	2021/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 6250	2, 204	2, 196	246, 165	2019/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 2500	3, 963	3, 918	439, 058	2020/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 5000	2, 427	2, 376	266, 291	2022/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 0000	5, 743	5, 636	631, 533	2025/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 5000	3, 763	3, 535	396, 176	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 3750	2, 788	2, 762	309, 502	2020/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 7500	1, 809	1, 788	200, 432	2022/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 3750	2, 792	2, 764	309, 787	2020/03/31	

外国債券インデックスマザーファンド

当			期		未			償還年月日
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,856	320,062	2022/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,722	641,249	2025/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,835	3,974	445,288	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,607	2,579	289,055	2020/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,578	288,969	2022/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,806	314,424	2022/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,013	2,988	334,915	2020/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,001	2,985	334,553	2020/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,828	316,883	2022/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,135	3,118	349,379	2020/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,172	243,412	2022/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,617	629,423	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,573	3,615	405,074	2045/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,422	271,455	2022/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,868	2,832	317,364	2020/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,433	272,702	2022/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,876	2,838	318,050	2020/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,809	650,943	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,116	3,072	344,291	2020/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	3,842	430,525	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,532	283,711	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,138	2,130	238,690	2018/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,073	344,357	2020/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,687	2,675	299,783	2022/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,151	2,142	240,012	2018/12/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	3,030	339,529	2020/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,492	2,494	279,465	2022/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,146	2,132	238,982	2019/01/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,126	3,075	344,576	2021/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,366	5,080	569,315	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,065	2,041	228,733	2019/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,515	281,823	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,428	3,213	360,039	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,100	2,080	233,161	2019/03/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,309	3,226	361,559	2021/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,262	2,192	245,615	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,936	329,041	2021/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	2,055	230,279	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,905	1,883	210,994	2019/04/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,029	5,695	638,232	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,404	269,394	2021/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,015	225,817	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	3,206	359,333	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,507	2,476	277,496	2019/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,647	296,647	2021/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,431	272,485	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,100	2,072	232,262	2019/06/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,428	272,071	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,876	322,307	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,460	275,690	2019/07/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,600	5,223	585,319	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	3,087	346,004	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,458	275,472	2019/08/15	

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	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250%	3,700	3,585	401,757	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,589	402,209	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,644	296,288	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,295	257,259	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,600	2,559	286,764	2019/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,395	268,382	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	2,944	329,935	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,147	2,117	237,215	2019/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,326	2,307	258,551	2018/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,500	5,337	598,027	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,915	326,720	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,423	271,544	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,650	3,689	413,391	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,400	1,379	154,582	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,000	993	111,336	2018/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,481	278,067	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,400	2,376	266,230	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,440	1,428	160,072	2019/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,998	223,907	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,400	1,393	156,164	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,506	280,867	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,500	1,487	166,663	2020/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,700	1,689	189,256	2019/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,040	3,996	447,833	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,991	335,162	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,484	278,381	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,875	4,014	449,794	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,130	2,110	236,501	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,300	2,283	255,872	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	2,989	335,004	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,287	256,284	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,900	1,892	212,054	2020/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,850	1,838	206,003	2019/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,250	4,224	473,307	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	900	893	100,095	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	850	843	94,557	2020/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,700	5,695	638,231	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,700	2,796	313,380	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	2,977	333,575	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	2,958	331,447	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	3,970	444,851	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,960	331,709	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,972	445,134	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	1,971	220,913	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,700	2,678	300,135	2020/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,969	444,784	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,958	331,447	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,363	264,864	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,000	1,982	222,172	2020/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	994	111,388	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,829	653,188	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,300	1,288	144,384	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,873	322,023	2022/07/31

外国債券インデックスマザーファンド

		当 期			末		
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 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	3,000	2,977	333,575	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,800	2,760	309,300	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,100	2,057	230,523	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	600	594	66,654	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,953	218,880	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	987	110,661	2020/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,475	277,410	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	993	111,292	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,371	377,724	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,000	993	111,318	2020/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,490	279,029	2022/10/31
通貨小計	銘柄数 金 額	244銘柄		626,026	632,164	70,834,003	
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	千カナダ・ドル 325	千カナダ・ドル 377	32,851	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	386	590	51,468	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,363	118,775	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,671	145,614	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,112	1,608	140,066	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,524	1,577	137,398	2019/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	1,799	156,773	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,876	1,969	171,541	2020/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	1,011	88,105	2021/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,838	160,152	2022/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,561	1,965	171,169	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,241	108,156	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,471	128,173	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	853	857	74,693	2019/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,627	1,636	142,546	2019/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,197	1,335	116,279	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,194	104,020	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,719	1,720	149,874	2020/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,831	1,795	156,371	2020/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,129	1,099	95,807	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,237	1,206	105,111	2021/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,480	1,437	125,176	2021/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,145	99,768	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,470	1,459	127,129	2018/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	840	802	69,899	2022/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,620	1,604	139,769	2019/02/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	900	892	77,715	2019/05/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	700	680	59,235	2022/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,360	1,345	117,171	2019/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	500	498	43,401	2019/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	301	26,285	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	600	602	52,473	2023/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	32銘柄		37,381	40,103	3,492,978	
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.2500	千オーストラリア・ドル 2,455	千オーストラリア・ドル 2,566	217,823	2019/03/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,728	231,592	2021/05/15

区 分		銘 柄		種 類	年利率	期		未		償還年月日
						額 面 金 額	評 価 額			
							外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
					%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		千円	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,409	2,560	217,289			2020/04/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,162	2,513	213,293			2022/07/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,420	205,411			2023/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,091	262,366			2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,473	2,547	216,236			2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,314	1,403	119,109			2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,398	2,548	216,254			2025/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,358	1,655	140,512			2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,848	3,249	275,769			2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,011	2,049	173,919			2019/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	863	964	81,821			2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	557	546	46,366			2035/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,195	2,187	185,645			2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	712	734	62,330			2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,142	2,195	186,305			2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,978	1,931	163,937			2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	932	891	75,647			2047/03/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	700	700	59,413			2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,450	1,480	125,634			2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	100	8,543			2022/11/21
通貨小計	銘柄数	22銘柄								
	金 額					38,134	41,065	3,485,224		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	696	727	60,552			2020/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	862	71,716			2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	465	38,732			2022/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.5000	599	608	50,613			2019/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	503	536	44,627			2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	359	380	31,657			2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	495	505	42,031			2021/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	413	34,357			2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	491	514	42,815			2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	368	413	34,391			2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	125	133	11,064			2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	415	416	34,617			2019/10/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	124	127	10,573			2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	224	226	18,865			2020/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	318	331	27,569			2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	250	251	20,932			2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	190	187	15,572			2021/10/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	200	200	16,670			2022/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	150	145	12,142			2036/08/01
通貨小計	銘柄数	19銘柄								
	金 額					7,117	7,446	619,502		
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,280	2,365	355,567			2020/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,121	2,254	338,940			2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,543	382,305			2021/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,332	1,676	251,981			2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,495	224,759			2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	310	305	45,907			2022/07/22

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			末		
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額	
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	460	419	63,031
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	200	195	29,431
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	600	599	90,107
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	510	503	75,728
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	500	493	74,211
		United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,383	208,037
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,394	209,657
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,340	1,786	268,542
		United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,873	281,676
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,032	2,803	421,457
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,457	2,188	328,940
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,724	1,889	283,994
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,878	432,698
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,086	3,169	476,434
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,565	235,397
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,596	2,418	363,584
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,480	2,033	305,654
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,523	2,400	360,875
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	873	917	137,890
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,246	1,770	266,225
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,572	236,384
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,870	2,612	392,776
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,428	1,510	227,012
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,244	2,086	313,672
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,795	1,952	293,512
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,268	341,073
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,633	1,820	273,624
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,352	2,023	304,157
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,338	351,613
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,066	2,626	394,780
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,942	2,083	313,185
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,621	2,610	392,381
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,251	2,296	345,204
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,842	2,045	307,500
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	2,828	425,149
通貨小計	銘柄数	41銘柄					
	金 額				60,444	75,999	11,425,072
スイス		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	404	499	56,847
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	497	707	80,495
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	517	546	62,192
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	407	439	49,990
		SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	362	395	44,985
通貨小計	銘柄数	5銘柄					
	金 額				2,187	2,587	294,510
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	11,512	19,533	348,480
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	8,601	9,387	167,471
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	8,050	9,132	162,929
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,302	94,599
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	8,363	9,421	168,079

		当 期			未 期		
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	
			%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,164	3,192	56,956	2018/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,600	2,613	46,620	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,534	27,371	2020/11/15
通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金 額			48,636	60,118	1,072,508	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	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	3.7500	7,075	7,491	101,727	2019/05/22
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,998	7,691	104,457	2021/05/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	5,224	5,471	74,296	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,539	61,651	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,495	47,475	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,365	45,709	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,450	2,501	33,970	2027/02/17
通貨小計	銘柄数	7銘柄					
	金 額			32,577	34,557	469,287	
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	千スウェーデン・クローネ		
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	9,095	10,614	142,025	2020/12/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,385	8,942	119,649	2019/03/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	5,723	76,575	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	9,892	132,365	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,624	102,009	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,095	5,930	79,353	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,680	5,932	79,371	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,950	2,955	39,543	2028/05/12
通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金 額			50,850	57,615	770,894	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.0000	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	21,447	20,619	124,333	2019/12/11
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	13,290	12,099	72,959	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	4,000	4,204	25,352	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	10,633	11,084	66,838	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	22,119	25,601	154,377	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	10,668	10,846	65,406	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,874	8,599	51,857	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	8,844	9,655	58,221	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	22,092	22,379	134,947	2018/12/13
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	9,694	10,683	64,423	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	18,928	19,343	116,639	2020/06/11
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	27,826	27,312	164,691	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	13,437	81,028	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	13,099	12,791	77,131	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	15,654	16,005	96,510	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	6,944	7,142	43,068	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	16銘柄					
	金 額			225,127	231,806	1,397,790	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7340	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	647	673	18,467	2019/07/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.2480	573	537	14,738	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	738	787	21,605	2028/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,603	1,640	44,985	2019/11/29
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,174	32,196	2030/04/15

外国債券インデックスマザーファンド

		当 期			未 期		
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. 1600	1, 916	1, 958	53, 702	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 3920	1, 514	1, 533	42, 047	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 2320	650	632	17, 339	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 4180	875	861	23, 610	2022/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 8920	731	711	19, 513	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 1270	618	595	16, 315	2032/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 4920	1, 044	1, 050	28, 805	2020/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 4800	1, 001	982	26, 928	2023/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 8440	477	444	12, 175	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 7330	586	558	15, 308	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 8890	656	664	18, 224	2020/07/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 9350	600	601	16, 494	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 1810	1, 057	1, 068	29, 300	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 0480	857	869	23, 836	2021/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 6540	648	654	17, 942	2019/10/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 9550	737	729	20, 002	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 6590	700	704	19, 328	2020/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 7950	1, 161	1, 160	31, 826	2022/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 2540	820	789	21, 638	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 7590	768	776	21, 289	2019/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 8000	702	697	19, 127	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 7360	930	910	24, 957	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 9000	650	637	17, 491	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 6200	352	352	9, 662	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 8820	500	504	13, 828	2022/03/10
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 0590	750	755	20, 721	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 8990	350	348	9, 549	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 7620	500	507	13, 921	2037/04/07
通貨小計	銘柄数	33銘柄					
	金 額			26, 889	26, 874	736, 885	
南アフリカ				千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 0000	2, 978	2, 993	24, 543	2018/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7. 2500	5, 768	5, 682	46, 600	2020/01/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10. 5000	16, 434	17, 622	144, 501	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6. 2500	7, 612	5, 229	42, 882	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6. 7500	4, 622	4, 417	36, 225	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6. 5000	8, 904	6, 007	49, 261	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7. 0000	8, 999	7, 172	58, 817	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7. 7500	5, 539	5, 340	43, 789	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 7500	13, 452	11, 553	94, 736	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 5000	11, 021	9, 479	77, 733	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 0000	8, 862	7, 763	63, 664	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 7500	7, 944	6, 818	55, 909	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 2500	8, 243	7, 191	58, 969	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 8750	4, 166	3, 752	30, 774	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9. 0000	2, 179	1, 933	15, 856	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			116, 723	102, 959	844, 266	
ポーランド				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
	Poland Government Bond	国債証券	5. 7500	2, 309	2, 638	83, 369	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	5. 5000	1, 912	2, 053	64, 884	2019/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1. 5000	2, 478	2, 462	77, 803	2020/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2. 5000	3, 377	3, 192	100, 870	2026/07/25

		当 期			未 期		
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	
			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,127	2,115	66,843	2021/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	3,051	2,999	94,782	2021/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,820	1,696	53,624	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,320	2,296	72,556	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	400	392	12,392	2019/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,300	1,290	40,786	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,033	32,674	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	2,256	2,466	77,948	2020/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,084	1,224	38,683	2021/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,225	2,367	74,813	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,840	1,893	59,841	2019/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,591	2,608	82,428	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		31,917	32,731	1,034,302	
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国債証券	4.4000	千ユーロ 684	千ユーロ 737	97,905	2019/06/18
	IRISH TREASURY	国債証券	5.9000	570	640	85,009	2019/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,131	1,535	203,928	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	5.0000	765	888	117,952	2020/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	504	607	80,719	2023/03/20
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	728	96,725	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	761	879	116,747	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	538	71,507	2022/03/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	681	717	95,225	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,107	147,127	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	350	360	47,942	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	—	50	50	6,659	2022/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	4.5000	1,035	1,160	154,097	2020/04/18
国 小 計	銘柄数 金 額	13銘柄		8,727	9,950	1,321,550	
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	千ユーロ 548	千ユーロ 765	101,731	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,239	1,856	246,554	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,355	2,083	276,648	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	953	126,587	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,347	1,450	192,668	2019/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,146	1,270	168,762	2020/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,349	2,112	280,576	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,463	1,662	220,792	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,609	213,694	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,445	192,013	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,531	203,406	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	924	944	125,475	2019/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,084	1,490	197,915	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,713	227,539	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,374	1,400	185,949	2020/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,291	1,297	172,278	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,338	1,357	180,258	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,218	161,762	2022/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	900	921	122,425	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	200	26,580	2024/01/15
国 小 計	銘柄数 金 額	20銘柄		23,054	27,284	3,623,622	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			未 期		
		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
							償還年月日
ユーロ (ベルギー)		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,453	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	924	927	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	558	614	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,283	1,344	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	744	738	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	190	204	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	150	151	2023/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,000	1,018	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	650	664	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	260	291	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	300	307	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,550	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,751	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	1,377	1,637	2022/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	821	871	2019/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	1,736	1,948	2020/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,674	2,636	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,706	2021/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,346	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,603	2022/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	680	958	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	1,123	1,197	2019/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,514	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	753	1,130	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,752	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	597	766	2034/06/22
国 小 計	銘 柄 数 金 額	26銘柄			26,235	32,088	4,261,666
ユーロ (フランス)		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	653	767	2019/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	985	1,446	2023/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,225	3,239	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,623	3,994	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,807	4,658	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,709	4,254	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,075	3,288	2019/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,364	2,205	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,230	3,694	2021/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,824	4,216	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,697	4,641	2023/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,734	4,426	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,263	3,539	2019/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,380	3,712	2020/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,167	1,936	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,977	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,113	3,386	2020/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,550	4,054	2021/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,630	4,157	2022/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,499	4,227	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	3,016	2022/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,238	3,075	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,686	2023/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,920	1,951	2018/11/25

区 分		当 期			未 評 価 額			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額		
						千ユーロ	千円	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500%	3,086	3,526	468,312	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,264	2,320	308,213	2019/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,787	3,322	441,301	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,799	3,112	413,332	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,322	2,374	315,363	2019/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,792	2,848	378,262	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,070	3,112	413,369	2020/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,101	2,217	294,528	2025/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,193	2,240	297,563	2020/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,720	2,902	385,442	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,592	1,605	213,264	2019/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,737	2,763	367,059	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,079	1,072	142,384	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	587	572	76,097	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,170	2,200	292,209	2021/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,354	312,719	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,021	268,422	2022/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	620	661	87,882	2039/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	709	94,167	2020/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,602	345,661	2027/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,000	1,077	143,045	2048/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	502	66,683	2023/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	500	501	66,652	2028/05/25	
国 小 計	銘柄数	47銘柄						
	金 額			108,392	128,181	17,023,784		
ユーロ (ドイツ)	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,353	179,776	2024/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,567	2,481	329,605	2027/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,067	274,648	2028/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,371	182,159	2028/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,586	210,674	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,336	310,273	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	2,864	380,478	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,071	3,191	423,903	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	2,006	266,498	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,399	2,463	327,114	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	2,682	2,816	373,995	2019/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,481	2,650	352,009	2019/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,075	2,248	298,641	2020/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,928	2,112	280,534	2020/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,474	2,169	288,130	2042/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,444	1,560	207,198	2020/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,558	339,848	2021/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,903	252,760	2021/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,562	207,502	2021/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,807	3,089	410,342	2022/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,439	324,003	2022/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,728	2,272	301,777	2044/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,788	237,555	2022/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,540	204,531	2023/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,987	264,021	2023/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,798	238,889	2023/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,741	231,298	2024/02/15	

外国債券インデックスマザーファンド

当 期				未 評 価 額			償還年月日
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000%	千ユーロ 1,959	千ユーロ 2,599	千円 345,238	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,756	233,250	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,649	219,046	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,268	301,216	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,283	303,303	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,168	2,229	296,037	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	2,793	370,964	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,591	211,399	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	700	707	93,949	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	300	302	40,159	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	950	957	127,135	2018/12/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,009	134,111	2019/03/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	404	53,754	2019/06/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	13,453	2019/09/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,438	1,469	195,161	2019/02/22
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,113	1,132	150,370	2019/04/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,151	1,171	155,652	2019/10/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,731	1,758	233,526	2020/04/17
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,448	1,484	197,128	2020/10/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,578	1,606	213,413	2021/04/09
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,425	189,284	2021/10/08	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	360	366	48,612	2022/04/08	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	405	53,890	2022/10/07	
国 小 計	銘柄数	50銘柄					
	金 額			76,126	89,437	11,878,234	
ユーロ (スペイン)	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	千ユーロ 1,952	千ユーロ 2,820	374,609	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,745	1,826	242,580	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,552	1,570	208,549	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,792	1,935	257,008	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1500	1,250	1,293	171,778	2020/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,835	243,794	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,672	1,683	223,643	2019/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,747	1,793	238,162	2021/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,052	1,083	143,900	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	550	598	79,501	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,730	1,734	230,317	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	580	584	77,636	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,818	241,532	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	550	564	74,974	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,295	172,038	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	300	300	39,943	2021/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	300	301	40,007	2022/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	2,934	389,741	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,654	2,143	284,630	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,608	2,279	302,736	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	2,102	279,174	2024/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6000	2,382	2,577	342,367	2019/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3000	1,775	1,932	256,659	2019/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,373	1,906	253,243	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,101	2,314	307,380	2020/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	1,789	2,271	301,636	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,681	1,923	255,491	2020/10/31

		当 期			未 評 価 額		
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	償 還 年 月 日
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,515	2,986	396,685	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,718	361,080	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,447	325,054	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,608	3,270	434,401	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,601	1,954	259,613	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,270	1,716	228,023	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,254	1,301	172,887	2018/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,049	1,543	205,057	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,836	1,916	254,577	2019/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,347	311,809	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,366	314,245	2024/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	1,967	261,249	2020/01/31
国 小 計	銘柄数 金 額	39銘柄		61,672	71,965	9,557,727	
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	1,622	215,456	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,633	216,910	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,425	454,897	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,970	261,761	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0500	1,445	1,482	196,955	2019/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,429	1,522	202,153	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,693	224,869	2022/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,704	226,434	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,765	1,644	218,394	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,511	1,541	204,749	2020/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,591	1,655	219,809	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,568	208,365	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	774	788	104,775	2020/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,440	1,371	182,202	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,359	2,388	317,265	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,286	1,290	171,343	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	812	817	108,506	2019/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,674	1,693	224,898	2021/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	924	884	117,507	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,568	1,520	201,919	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	700	690	91,730	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,363	181,077	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	448	405	53,828	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	858	863	114,665	2019/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	700	706	93,770	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,060	1,102	146,443	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	314	41,747	2024/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	350	361	48,036	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	120	121	16,116	2020/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	600	650	86,385	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,000	1,023	135,917	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	700	711	94,560	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	550	558	74,130	2024/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	100	100	13,357	2020/10/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,454	3,294	437,522	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,119	547,146	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,655	2,375	315,521	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,074	2,187	290,498	2019/02/01

外国債券インデックスマザーファンド

当 期				未 評 価 額			償還年月日
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	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	1,921	2,118	281,355	2020/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,498	3,379	448,833	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,790	3,396	451,136	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	3,088	410,175	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,734	2,380	316,198	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,745	364,647	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,708	2,873	381,613	2019/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,531	2,734	363,127	2019/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,665	353,994	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,043	2,784	369,788	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,560	2,817	374,179	2020/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,214	2,461	326,915	2020/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,552	338,975	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,399	318,623	2021/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,667	354,278	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,404	319,339	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	2,044	271,533	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,910	2,365	314,151	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,810	2,308	306,528	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,270	301,543	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,363	1,821	241,882	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,655	352,710	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,111	2,194	291,399	2018/12/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,729	1,942	257,964	2021/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.5000	1,100	1,144	152,019	2019/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,570	341,347	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,938	2,230	296,271	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,710	227,143	2021/12/15
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	1.5000	1,246	1,284	170,544	2019/08/01	
国 小 計	銘柄数	67銘柄					
	金 額			107,051	123,182	16,359,857	
ユーロ (フィンランド)				千ユーロ	千ユーロ		
	Finland Government Bond	国債証券	0.3750	432	443	58,854	2020/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	410	54,535	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	292	38,812	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	411	416	55,296	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	200	26,576	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	270	273	36,293	2022/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	298	39,664	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.3750	416	449	59,734	2019/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	857	113,846	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	3.3750	632	691	91,892	2020/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	3.5000	459	520	69,149	2021/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	476	63,246	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	612	666	88,529	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	484	64,327	2023/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	539	71,660	2042/07/04
Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	593	78,877	2024/04/15	
国 小 計	銘柄数	16銘柄					
	金 額			6,863	7,614	1,011,296	
ユーロ (オーストリア)				千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Austria Government Bond	国債証券	0.2500	527	535	71,146	2019/10/18
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	936	124,418	2025/10/20

区 分		当 期			末		
		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
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500%	千ユーロ926	千ユーロ950	千円126,301
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	734	737	97,998
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	150	131	17,529
		Austria Government Bond	国債証券	—	300	301	39,980
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	380	378	50,326
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	170	180	23,991
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	404	53,748
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,280	170,103
		Austria Government Bond	国債証券	3.9000	1,248	1,394	185,142
		Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,538	204,313
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,073	1,637	217,465
		Austria Government Bond	国債証券	4.3500	989	1,052	139,844
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,206	160,179
		Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	936	124,393
		Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	1,030	136,907
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	318	536	71,245
		Austria Government Bond	国債証券	1.9500	738	767	101,978
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	870	115,608
		Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,061	141,037
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	621	748	99,427
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,030	136,914
国 小 計	銘柄数	23銘柄					
	金 額				16,667	19,652	2,610,004
通貨小計	銘柄数	301銘柄					
	金 額				434,787	509,357	67,647,744
合 計	銘柄数	767銘柄					
	金 額						164,124,972

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

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円164,124,972	%98.4
コール・ローン等、その他	2,713,114	1.6
投資信託財産総額	166,838,087	100.0

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

外国債券インデックスマザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

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

* 期首における元本額は59,006,131,580円、当期中における追加設定元本額は6,421,510,499円、同解約元本額は6,043,863,314円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスV A 938,947,637円、ダイワ国内重視バランスファンド3 0 V A（一般投資家私募）31,434,341円、ダイワ国内重視バランスファンド5 0 V A（一般投資家私募）236,831,181円、ダイワ国際分散バランスファンド3 0 V A（一般投資家私募）64,229,316円、ダイワ国際分散バランスファンド5 0 V A（一般投資家私募）766,547,584円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）248,867,657円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）525,569,264円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）400,023,699円、D－I's 外国債券インデックス880,097円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 22,820円、iFree 外国債券インデックス575,119,716円、iFree 8 資産バランス245,604,315円、D Cダイワ外国債券インデックス40,005,557,043円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 631,956,912円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 299,143,351円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 190,473,853円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）268,358,922円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）217,548,839円、D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）67,378,321円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 11,337,304円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 17,901,368円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 1,288,876円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A 497,823,550円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 166,073,932円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 6,394,036,947円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 359,421,809円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 142,269,988円、ダイワ・バランスファンド2 5 V A（適格機関投資家専用）353,656,108円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券126,558,233円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド21,849,007円、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）374,472円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,466,036,292円、ダイワライフスタイル2 5 34,455,585円、ダイワライフスタイル5 0 59,697,716円、ダイワライフスタイル7 5 16,502,710円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は28,075円です。

■損益の状況

当期 自 2016年12月1日 至 2017年11月30日

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

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

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／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。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）
マザーファンドの運用方法	①東京証券取引所が算出・公表する「東証ＲＥＩＴ指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ②投資成果を「東証ＲＥＩＴ指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証ＲＥＩＴ指数」の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。 ③運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率 マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	無制限
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

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

ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス （ダイワＳＭＡ専用）

運用報告書（全体版） 第２期 （決算日 2018年６月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）」は、このたび、第２期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			東証ＲＥＩＴ指数 (配当込み)		投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 数 先 物 率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6 月15日)	9,782	50	△ 1.7	3,274.94	△ 1.6	98.8	1.4	3
2 期末 (2018年 6 月15日)	10,077	45	3.5	3,398.25	3.8	98.7	1.5	321

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) 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 3) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注 1) 期末の基準価額は分配金込みです。

(注 2) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

*ベンチマークは東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）です。

基準価額・騰落率

期首：9,782円

期末：10,077円（分配金45円）

騰落率：3.5%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

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行なった結果、国内リート市況が上昇したことを反映して、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）

年 月 日	基 準 価 額		東証ＲＥＩＴ指数 (配当込み)		投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 数 先 物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2017年 6 月15日	円	%		%	%	%
	9,782	—	3,274.94	—	98.8	1.4
6 月末	9,500	△ 2.9	3,180.48	△ 2.9	98.2	1.4
7 月末	9,615	△ 1.7	3,220.02	△ 1.7	98.1	1.4
8 月末	9,519	△ 2.7	3,188.63	△ 2.6	98.2	1.5
9 月末	9,371	△ 4.2	3,139.87	△ 4.1	98.0	1.5
10月末	9,248	△ 5.5	3,099.44	△ 5.4	98.1	1.6
11月末	9,514	△ 2.7	3,189.89	△ 2.6	98.0	1.6
12月末	9,510	△ 2.8	3,189.59	△ 2.6	98.2	1.4
2018年 1 月末	10,005	2.3	3,357.09	2.5	98.1	1.4
2 月末	9,807	0.3	3,291.44	0.5	97.8	1.5
3 月末	9,756	△ 0.3	3,274.92	△ 0.0	97.8	1.6
4 月末	10,005	2.3	3,358.59	2.6	97.8	1.6
5 月末	10,067	2.9	3,379.45	3.2	98.0	1.6
(期末) 2018年 6 月15日	10,122	3.5	3,398.25	3.8	98.7	1.5

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■国内リート市況

国内リート市況は、期首より、海外を中心に中期的な金利上昇への警戒感が残っていることや、海外投資家および国内リートに投資する投資信託からの資金流出などを背景に、2017年7月にかけて下落基調で推移しました。その後は一時反発しましたが、北朝鮮に関わる地政学リスクが高まったことや米国の長期金利が上昇したことから、再び下落しました。しかし2017年11月中旬には、自己投資口取得やリート同士の合併の発表などを材料に上昇に転じました。2018年に入ると、事業環境が良好なことから国内外投資家からの資金が継続的に流入したことなどにより、好調な推移となりました。しかし2月に入ると、米国の長期金利が急上昇したことなどをを受けて国内外で株式市場が下落する中で、国内リート市場も下落しました。3月以降は、オフィス市況など事業環境の良さが継続していることや日本の長期金利が低位安定推移となったことなどを背景に上昇し、期末を迎えました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

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。

ポートフォリオについて

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券を通じて行ないました。なお、期末のリート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。以下同じ。）は100.2%となっておりますが、翌営業日計上のマザー解約金額を考慮したリート実質組入比率は100%程度となっております。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

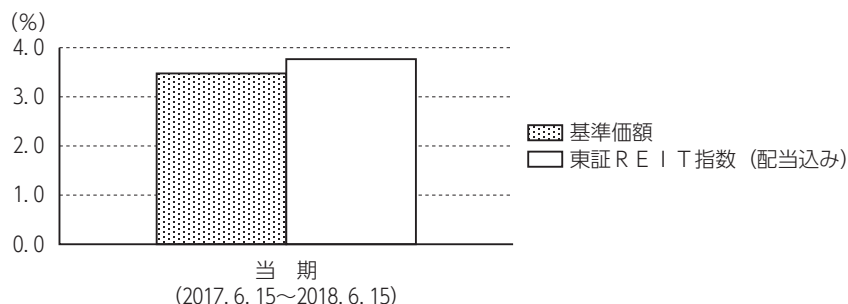
ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物含む。）については、期を通じて99～100%程度としました。

ベンチマークとの差異について

当期のベンチマークの騰落率は3.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は3.5%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当期の１万口当り分配金（税込み）は45円といたしました。

収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（１万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（１万口当り）

項 目	当 期	
	2017年6月16日 ～2018年6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	45
対基準価額比率	(%)	0.44
当期の収益	(円)	20
当期の収益以外	(円)	25
翌期繰越分配対象額	(円)	76

（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。

■収益分配金の計算過程（１万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	21.65円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1.66
(c) 収益調整金	98.36
(d) 分配準備積立金	0.08
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	121.76
(f) 分配金	45.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	76.76

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 6. 16～2018. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	32円	0. 335%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9, 618円です。
(投 信 会 社)	(20)	(0. 205)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(10)	(0. 108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0. 022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0. 003	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先 物)	(0)	(0. 003)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 006	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 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	33	0. 344	

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

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況
(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ Ｊ－ＲＥＩＴ マザーファンド	126,204	317,600	32	80

(注) 単位未満は切捨て。

- 利害関係人との取引状況等
- (1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況
当期中における利害関係人との取引はありません。
- (2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況
当期中における利害関係人との取引はありません。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等
(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

種 類	当 期		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
投資信託証券	64	1,095	3,515

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって
発行される有価証券
(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

種 類	当 期
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド
	買 付 額
	百万円
投資信託証券	1,007

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

- (5) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率
当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■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

期首保有額	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

(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	期 首	当 期	末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワＪ－ＲＥＩＴ マザーファンド	1,427	127,599	321,845

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワＪ－ＲＥＩＴ マザーファンド	321,845	99.8
コール・ローン等、その他	702	0.2
投資信託財産総額	322,547	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	322,547,315円
コール・ローン等	684,680
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド (評価額)	321,845,235
未収入金	17,400
(B) 負債	1,496,256
未払収益分配金	1,433,724
未払信託報酬	61,476
その他未払費用	1,056
(C) 純資産総額 (A－B)	321,051,059
元本	318,605,408
次期繰越損益金	2,445,651
(D) 受益権総口数	318,605,408口
1万口当り基準価額 (C／D)	10,077円

*期首における元本額は3,533,441円、当期中における追加設定元本額は315,071,967円、同解約元本額は0円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は10,077円です。

■損益の状況

当期 自 2017年 6月16日 至 2018年 6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6円
支払利息	△ 6
(B) 有価証券売買損益	857, 208
売買益	857, 569
売買損	△ 361
(C) 信託報酬等	△ 68, 205
(D) 当期損益金 (A + B + C)	788, 997
(E) 前期繰越損益金	△ 43, 519
(F) 追加信託差損益金	3, 133, 897
(配当等相当額)	(867, 073)
(売買損益相当額)	(2, 266, 824)
(G) 合計 (D + E + F)	3, 879, 375
(H) 収益分配金	△ 1, 433, 724
次期繰越損益金 (G + H)	2, 445, 651
追加信託差損益金	2, 337, 384
(配当等相当額)	(70, 560)
(売買損益相当額)	(2, 266, 824)
分配準備積立金	108, 267

- (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	689, 840円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	53, 064
(c) 収益調整金	3, 133, 897
(d) 分配準備積立金	2, 574
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	3, 879, 375
(f) 分配金	1, 433, 724
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2, 445, 651
(h) 受益権総口数	318, 605, 408口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	45円

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20. 315%（所得税15%、復興特別所得税0. 315%および地方税 5 %）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

<補足情報>

当ファンド（ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用））が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の決算日（2018年３月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年６月15日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの組入資産の内容等を302～303ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの主要な売買銘柄 投資信託証券

（2017年６月16日から2018年６月15日まで）

買 付				売 付			
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
日本プロロジスリート	4.94	1,138,666	230,499	日本ビルファンド	8.543	4,864,659	569,432
ＧＬＰ投資法人	8.832	1,020,731	115,571	ジャパンリアルエステイト	8.162	4,467,274	547,325
大和ハウスリート投資法人	3.89	981,165	252,227	日本リテールファンド	17.876	3,658,213	204,643
ジャパンリアルエステイト	1.581	878,548	555,691	野村不動産マスターＦ	24.461	3,560,594	145,562
三菱地所物流 REIT	2.725	749,955	275,213	ユナイテッド・アーバン投資法人	19.457	3,186,368	163,764
インヴィンシブル投資法人	14.788	673,468	45,541	オリックス不動産投資	16.256	2,618,945	161,106
インベスコ・オフィス・Ｊリート	38.64	561,776	14,538	日本プロロジスリート	10.494	2,491,061	237,379
星野リゾート・リート	0.935	518,183	554,206	大和ハウスリート投資法人	8.985	2,371,575	263,948
ジャパン・ホテル・リート投資法人	6.281	492,346	78,386	アドバンス・レジデンス	8.166	2,232,412	273,378
野村不動産マスターＦ	2.933	433,281	147,726	日本プライムリアルティ	5.571	2,119,543	380,460

（注１）金額は受渡し代金。

（注２）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年６月15日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（84,131,299千口）の内容です。

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	2018年６月15日現在		
	口 数	評価額	比 率
	千口	千円	%
不動産投信			
日本アコモデーションファンド投資法人	8.491	4,169,081	2.0
MCUBS MidCity投資法人	28.509	2,366,247	1.1
森ヒルズリート	27.448	3,845,464	1.8
産業ファンド	29.675	3,584,740	1.7
アドバンス・レジデンス	23.657	6,564,817	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	12.998	2,106,975	1.0
ＡＰＩ投資法人	11.559	5,606,115	2.6
ＧＬＰ投資法人	53.043	6,328,029	3.0
コンフォリア・レジデンシャル	9.685	2,511,320	1.2
日本プロロジスリート	34.056	7,819,257	3.7
星野リゾート・リート	4.038	2,269,356	1.1
Oneリート投資法人	2.793	702,998	0.3
イオンリート投資	24.264	2,977,192	1.4
ヒューリックリート投資法	17.353	2,929,186	1.4
日本リート投資法人	6.865	2,244,855	1.1
インベスコ・オフィス・Ｊリート	150.554	2,198,088	1.0

ファンド名	2018年６月15日現在		
	口 数	評価額	比 率
	千口	千円	%
日本ヘルスケア投資法	1.239	211,373	0.1
積水ハウス・リート投資	64.0174	4,397,995	2.1
トーセイ・リート投資法人	4.108	460,917	0.2
ケネディクス商業リート	9.291	2,276,295	1.1
ヘルスケア＆メディカル投資	3.148	345,020	0.2
サムティ・レジデンシャル	4.437	427,283	0.2
野村不動産マスターＦ	75.614	11,886,520	5.6
いちごホテルリート投資	3.998	530,934	0.3
ラサールロジポート投資	19.276	2,141,563	1.0
スターアジア不動産投	5.993	634,658	0.3
マリモ地方創生リート	2.046	239,382	0.1
三井不動産パーク	4.833	1,635,970	0.8
大江戸温泉リート	4.289	374,429	0.2
さくら総合リート	6.143	565,770	0.3
投資法人みらい	3.73	697,510	0.3
森トラスト・ホテルリート投	5.534	816,818	0.4

ダイワリー・REITマザーファンド

ファンド名		2018年6月15日現在		
		□ 数	評価額	比 率
		千口	千円	%
三菱地所物流 REIT		2,368	639,360	0.3
CRE ロジスティクスファンド		2,558	291,356	0.1
ザイマックス・リート		2,356	268,584	0.1
日本ビルファンド		24,743	15,315,917	7.2
ジャパンリアルエステイト		25,424	14,542,528	6.9
日本リテールファンド		48,248	9,683,373	4.6
オリックス不動産投資		50,697	8,831,417	4.2
日本プライムリアルティ		16,132	6,517,328	3.1
プレミア投資法人		23,079	2,444,066	1.2
東急リアル・エステート		17,131	2,545,666	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人		16,228	1,785,080	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人		56,354	9,721,065	4.6
森トラスト総合リート		18,261	2,921,760	1.4
インヴェンシブル投資法人		70,077	3,559,911	1.7
フロンティア不動産投資		8,692	3,920,092	1.8
平和不動産リート		15,912	1,715,313	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人		17,022	3,835,056	1.8
福岡リート投資法人		13,215	2,296,767	1.1
ケネディクス・オフィス投資法人		7,884	5,392,656	2.5
いちごオフィスリート投資法人		19,785	1,646,112	0.8
大和証券オフィス投資法人		5,51	3,515,380	1.7
阪急リート投資法人		11,154	1,534,790	0.7
スターツプロシード投資法人		4,026	654,627	0.3
大和ハウスリート投資法人		29,73	7,786,287	3.7
ジャパン・ホテル・リート投資法人		73,747	5,973,507	2.8
日本賃貸住宅投資法人		28,74	2,509,002	1.2
ジャパンエクセレント投資法人		22,881	3,304,016	1.6
合 計	□ 数、金 額	1,294,6384	209,017,190	
	銘柄数 < 比率 >	59 銘柄		<98.5%>

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2)先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘 柄 別		2018年6月15日現在	
		買 建 額	売 建 額
国		百万円	百万円
内	東証REIT	3,098	—

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

運用報告書 第28期（決算日 2018年3月15日）

（計算期間 2017年9月16日～2018年3月15日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの第28期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

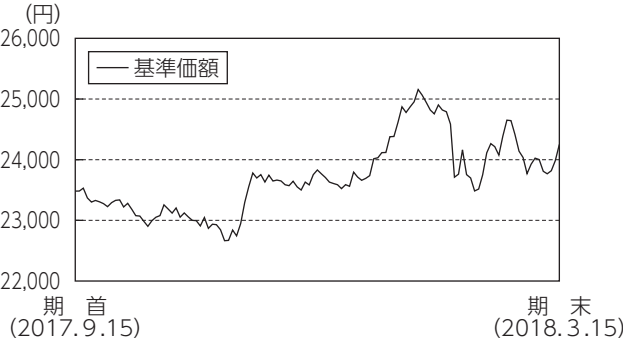
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		東証ＲＥＩＴ指数(配当込み)		投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指数先物 比率
	円	騰 落 率 %	(ベンチマーク)	騰 落 率 %	%	%
(期首)2017年 9月15日	23,482	—	3,165.38	—	98.5	1.5
9 月末	23,293	△0.8	3,139.87	△0.8	98.2	1.5
10月末	22,995	△2.1	3,099.44	△2.1	98.3	1.6
11月末	23,664	0.8	3,189.89	0.8	98.2	1.6
12月末	23,660	0.8	3,189.59	0.8	98.4	1.4
2018年 1 月末	24,902	6.0	3,357.09	6.1	98.3	1.4
2 月末	24,415	4.0	3,291.44	4.0	98.0	1.5
(期末)2018年 3月15日	24,252	3.3	3,269.20	3.3	98.2	1.6

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：23,482円 期末：24,252円 騰落率：3.3%

【基準価額の主な変動要因】

東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざした運用を行なった結果、国内リートの投資口価格の割安感が高まったことなどを背景に、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は、期首より、北朝鮮をめぐる地政学リスクの高まりや、好調な経済指標などを背景に米国の長期金利が上昇したことから、下落して始まりました。不動産市況が活況な一方でリート市況は低迷しましたが、徐々に割安感が高まり、自己投資口取得やM&A（企業の合併・買収）などを材料に、2017年11月中旬から上昇に転じました。2018年に入ると、事業環境が良好なことから国内外投資家からの資金が継続的に流入したことや、日本株に比べ出遅れ感があったことなどから好調な推移となりました。しかし2月に入ると、1月の米国雇用統計をきっかけに国内外で株式市場が下落する中で、国内リート市場も下落しました。その後は反発する場面も見られたものの、期末にかけて不安定な推移となりました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は3.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は3.3%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2017年9月16日から2018年3月15日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内	205.738	6,418,448	201.682 ()	36,915,368 ()

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2017年9月16日から2018年3月15日まで)

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	不動産投信指数先物取引	百万円 6,568	百万円 6,916	百万円 －	百万円 －

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託証券

(2017年9月16日から2018年3月15日まで)

当					期			
買		付			売		付	
銘	柄	口 数	金 額	平均単価	銘	柄	口 数	金 額
		千口	千円	円			千口	千円
G L P 投資法人		8.203	945,014	115,203	日本ビルファンド		4.898	2,733,487
三菱地所物流 R E I T		2.716	747,568	275,246	ジャパンリアルエステイト		4.783	2,573,695
インヴィンシブル投資法人		13.975	633,697	45,345	日本リテールファンド		9.733	1,980,922
日本プロロジスリート		1.917	435,558	227,208	野村不動産マスターＦ		13.554	1,921,938
星野リゾート・リート		0.727	405,629	557,949	ユナイテッド・アーバン投資法人		11.157	1,830,747
野村不動産マスターＦ		1.946	282,508	145,174	日本プロロジスリート		6.066	1,449,207
三井不ロジパーク		0.708	266,966	377,070	オリックス不動産投資		8.93	1,417,867
産業ファンド		1.796	230,120	128,129	大和ハウスリート投資法人		5.052	1,328,812
A P I 投資法人		0.476	224,735	472,132	アドバンス・レジデンス		4.683	1,269,768
イオンリート投資		1.764	201,839	114,421	日本プライムリアルティ		3.194	1,179,350

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

フ ア ン ド 名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
不動産投信	千口	千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人	8.842	4,204,371	2.0
MCUBS MidCity投資法人	29.689	2,274,177	1.1
森ヒルズリート	28.585	3,864,692	1.8
産業ファンド	30.914	3,697,314	1.7
アドバンス・レジデンス	24.636	6,863,589	3.2
ケネディクス・レジデンシャル・ネスト投資法人	13.536	2,057,472	1.0
A P I 投資法人	12.038	5,651,841	2.7
G L P 投資法人	55.238	6,457,322	3.1
コンフォリア・レジデンシャル	10.086	2,480,147	1.2
日本プロロジスリート	35.466	8,249,391	3.9
星野リゾート・リート	4.04	2,274,520	1.1
Oneリート投資法人	2.909	712,995	0.3
イオンリート投資	25.268	2,857,810	1.4
ヒューリックリート投資法	18.071	2,913,045	1.4
日本リート投資法人	7.149	2,298,403	1.1
インベスコ・オフィス・リート	117.948	1,776,296	0.8
日本ヘルスケア投資法	1.29	223,815	0.1
積水ハウス・リート投資	16.691	2,410,180	1.1
トーセイ・リート投資法人	4.278	477,424	0.2
ケネディクス商業リート	9.676	2,330,948	1.1
ヘルスケア&メディカル投資	3.279	343,967	0.2
サムティ・レジデンシャル	4.621	425,594	0.2
野村不動産マスターF	78.747	11,410,440	5.4
いちごホテルリート投資	4.163	519,958	0.2
ラサールロジポート投資	20.074	2,280,406	1.1
スターアジア不動産投	6.241	642,823	0.3
マリモ地方創生リート	2.13	236,217	0.1
三井不ロジパーク	5.033	1,769,099	0.8
大江戸温泉リート	4.467	383,715	0.2
さくら総合リート	6.397	600,038	0.3
投資法人みらい	3.386	637,245	0.3
森トラスト・ホテルリート投	5.763	824,109	0.4
三菱地所物流REIT	2.466	644,859	0.3
日本ビルファンド	25.768	14,919,672	7.1
ジャパンリアルエステイト	25.151	13,833,050	6.5
日本リテールファンド	51.189	10,411,842	4.9
オリックス不動産投資	52.797	8,753,742	4.1
日本プライムリアルティ	16.799	6,266,027	3.0
プレミアム投資法人	24.034	2,667,774	1.3
東急リアル・エステート	17.84	2,556,472	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人	4.272	1,742,976	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	58.687	9,865,284	4.7
森トラスト総合リート	19.017	3,033,211	1.4

フ ア ン ド 名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
インヴィンシブル投資法人	72.978	3,586,868	1.7
フロンティア不動産投資	9.051	3,964,338	1.9
平和不動産リート	16.57	1,660,314	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	17.726	3,873,131	1.8
福岡リート投資法人	13.762	2,284,492	1.1
ケネディクス・オフィス投資法人	7.778	5,149,036	2.4
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	20.174	2,388,601	1.1
いちごオフィスリート投資法人	20.604	1,631,836	0.8
大和証券オフィス投資法人	5.738	3,557,560	1.7
阪急リート投資法人	11.615	1,542,472	0.7
スターツプロシード投資法人	4.193	696,876	0.3
大和ハウスリート投資法人	27.517	6,851,733	3.2
ジャパン・ホテル・リート投資法人	76.8	5,928,960	2.8
日本賃貸住宅投資法人	29.929	2,484,107	1.2
ジャパンエクセレント投資法人	23.828	3,393,107	1.6
合 計	□ 数、金 額 銘柄数<比率>	1,256,934 58銘柄	207,837,718 <98.2%>

※産業ファンド、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、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、サムティ・レジデンシャル、マリモ地方創生リート、三井不ロジパーク、三菱地所物流 R E I T、日本ビルファンド、日本リテールファンド、オリックス不動産投資、日本プライムリアルティ、グローバル・ワン不動産投資法人、平和不動産リート、日本ロジスティクスファンド投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急リート投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人につきましては、各ファンドで開示されている直近の有価証券報告書または有価証券届出書において、当社の利害関係人等（投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される法人等をいいます。）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) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国 内	百万円 3,351	百万円 －
東証 R E I T		

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年3月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託証券	207,837,718	97.3
コール・ローン等、その他	5,691,751	2.7
投資信託財産総額	213,529,470	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年3月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	213,888,445,160円
コール・ローン等	1,233,781,303
投資信託証券(評価額)	207,837,718,980
未収入金	1,684,472,652
未収配当金	2,773,497,225
差入委託証拠金	358,975,000
(B) 負債	2,303,430,634
未払金	104,064,660
未払解約金	1,813,590,100
差入委託証拠金代用有価証券	385,775,000
その他未払費用	874
(C) 純資産総額(A－B)	211,585,014,526
元本	87,243,538,784
次期繰越損益金	124,341,475,742
(D) 受益権総口数	87,243,538,784口
1万口当り基準価額(C／D)	24,252円

* 期首における元本額は102,250,435,372円、当期中における追加設定元本額は1,897,822,046円、同解約元本額は16,904,718,634円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン9,204,141,206円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）70,871,803,139円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）411,842,431円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 30,514円、i F r e e Ｊ－ＲＥＩＴインデックス128,856,294円、i F r e e 8 資産バランス345,334,609円、ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン3,494,921,588円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 3,156,621円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 5,659,387円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 1,303,201円、ダイワ・ノーロード Ｊ－ＲＥＩＴファンド55,432,814円、ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス899,788,452円、ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワSMA専用）1,416,373円、ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス300,053,575円、ダイワ・インデックスセレクト Ｊ－ＲＥＩＴ1,519,798,580円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,252円です。

■損益の状況

当期 自2017年9月16日 至2018年3月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,734,234,464円
受取配当金	4,729,720,862
その他収益金	5,011,082
支払利息	△ 497,480
(B) 有価証券売買損益	1,947,567,160
売買益	5,709,420,396
売買損	△ 3,761,853,236
(C) 先物取引等損益	109,167,456
取引益	112,862,856
取引損	△ 3,695,400
(D) その他費用	△ 874
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	6,790,968,206
(F) 前期繰越損益金	137,856,800,148
(G) 解約差損益金	△ 22,900,912,266
(H) 追加信託差損益金	2,594,619,654
(I) 合計(E + F + G + H)	124,341,475,742
次期繰越損益金(I)	124,341,475,742

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

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）	
信託期間	無期限	
運用方針	海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	イ、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 ロ、先進国ＲＥＩＴ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。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）
	先進国ＲＥＩＴマザーファンド	イ、先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ、先進国のリート指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券） ハ、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引 ニ、国内の債券
ベビーファンドの運用方法	①主として、マザーファンドの受益証券を通じて、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。 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。 ※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。 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。	
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 ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの投資信託証券組入上限比率 先進国ＲＥＩＴ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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

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

ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス （為替ヘッジあり） （ダイワＳＭＡ専用）

運用報告書（全体版） 第２期 （決算日 2018年６月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）」は、このたび、第２期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

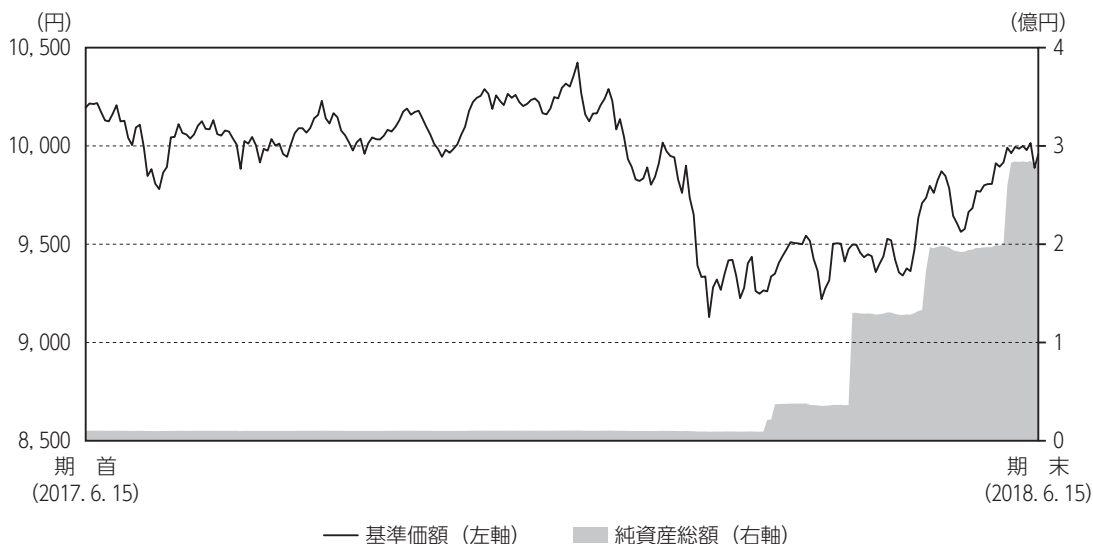
決 算 期	基 準 価 額			S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (現地通貨ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 数 先 物 比 率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(参考指数)	期 中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6 月15日)	10, 195	80	2. 8	10, 387	3. 9	—	98. 7	—	10
2 期末 (2018年 6 月15日)	9, 848	110	△ 2. 3	10, 520	1. 3	0. 8	100. 0	1. 0	279

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) S & P 先進国 R E I T 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 R E I T 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 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) 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) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



（注）期末の基準価額は分配金込みです。

■基準価額・騰落率

期首：10,195円

期末：9,848円（分配金110円）

騰落率：△2.3%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートに投資し、為替ヘッジした結果、米国リート市況の下落や為替ヘッジコストの影響が大きく、当ファンドの基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 先 物 比 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
(期首)2017年6月15日	円	%		%	%	%	%
	10,195	—	10,387	—	—	98.7	—
6月末	10,041	△ 1.5	10,244	△ 1.4	—	100.5	—
7月末	10,087	△ 1.1	10,314	△ 0.7	0.3	98.1	—
8月末	10,007	△ 1.8	10,254	△ 1.3	0.2	98.8	—
9月末	10,014	△ 1.8	10,276	△ 1.1	0.6	100.6	—
10月末	9,965	△ 2.3	10,248	△ 1.3	0.4	98.8	0.6
11月末	10,214	0.2	10,528	1.4	0.3	97.6	0.5
12月末	10,290	0.9	10,638	2.4	1.0	97.9	1.2
2018年1月末	9,761	△ 4.3	10,110	△ 2.7	0.9	95.1	1.1
2月末	9,262	△ 9.2	9,601	△ 7.6	0.6	95.7	1.1
3月末	9,505	△ 6.8	9,880	△ 4.9	0.8	97.8	1.0
4月末	9,471	△ 7.1	9,926	△ 4.4	0.8	100.0	1.0
5月末	9,912	△ 2.8	10,437	0.5	0.7	96.8	1.0
(期末)2018年6月15日	9,958	△ 2.3	10,520	1.3	0.8	100.0	1.0

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■海外リート市況

米国リート市況は、期首より、米国景気の底堅さやトランプ政権に対する政策期待などの好材料がある一方、利上げ懸念や北朝鮮をはじめとした地政学リスクもあって、方向感のない動きとなりました。しかし2018年に入ると、好調な経済指標の発表により早期利上げ観測が高まったことから長期金利が上昇し、利回り資産としてのリートに売り圧力が強まりました。期末にかけては、主要リートの好調な決算発表を受けやや値を戻しました。カナダリート市況は、期を通じて緩やかな上昇となりました。

欧州リート市況は、期首より、ドイツなどで長期金利が上昇に転じたことや、フランス大手リートの増資発表が悪材料となり、上値が重い展開となりました。その後は、長期金利の影響を受ける一進一退の値動きとなりました。2017年11月から12月にかけては、好調な不動産ファンダメンタルズや大手商業施設リートに対する買収観測などが好材料となり、フランスやドイツを中心として総じて堅調に推移しました。2018年に入ると、堅調な景気を受けた長期金利の上昇や米国株式の急落から売られる展開となりましたが、期末にかけては急落の反動で緩やかな上昇に転じました。

アジア・オセアニアリート市況は、香港およびシンガポールは、期首から、自国金利が低下に転じたことや中国政府への政策期待などにより、上昇しました。2017年8月以降は、アジアでは小動きの展開となりましたが、11月からは、一部リートの好決算や世界的な景気見通しの改善などを反映し、上昇しました。2018年に入ると、他地域と同様に下落基調となりましたが、期末にかけて香港は再び上昇しました。オーストラリアは、期首から商業施設セクターを中心に売られましたが、その後はアジア地域と似た値動きとなりました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

引き続き「ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド」および「先進国 R E I T マザーファンド」の受益証券に投資します。また、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。

■ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド

引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマーク（S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。リートの組入比率は、期を通じて原則として98%以上で運用を行ないます。

■先進国 R E I T マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に、日本を除く先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。

ポートフォリオについて

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■当ファンド

「ダイワ・グローバル R E I T 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。「先進国 R E I T マザーファンド」の受益証券への投資は、現在行なっておりません。また、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 R E I T 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、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行ないました。

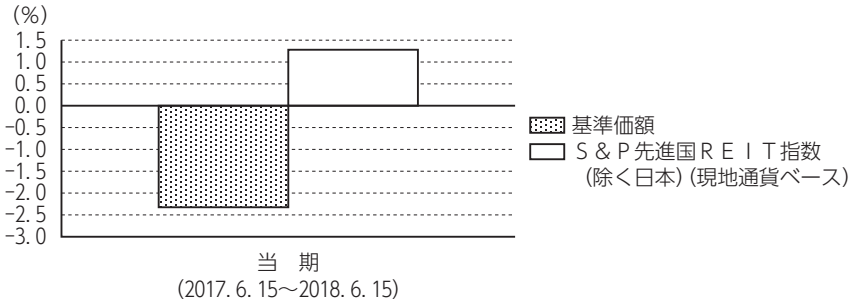
また、運用の効率化を図るため、外国投資信託（E T F）および不動産投信指数先物を組み入れました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。参考指数とのかい離要因は、為替ヘッジを行なったことによるものです。

ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンドについては、配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。なお、組み入れている不動産投資信託証券ポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。



分配金について

当期の 1 万口当り分配金（税込み）は 110 円といたしました。

収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1 万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1 万口当り）

項 目	当 期	
	2017 年 6 月 16 日 ～2018 年 6 月 15 日	
当期分配金（税込み）（円）	110	
対基準価額比率（％）	1. 10	
当期の収益（円）	50	
当期の収益以外（円）	60	
翌期繰越分配対象額（円）	395	

- （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。

収益分配金の計算過程（1 万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	66. 14 円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	218. 97
(c) 収益調整金	213. 32
(d) 分配準備積立金	6. 64
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	505. 08
(f) 分配金	110. 00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	395. 08

- （注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」および「先進国ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券に投資します。また、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。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

■先進国ＲＥＩＴマザーファンド

日本を除く先進国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、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 6. 16～2018. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	42円	0. 426%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9, 885円です。
(投 信 会 社)	(29)	(0. 297)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(11)	(0. 108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0. 022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	2	0. 023	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先 物)	(0)	(0. 005)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0. 001)	
(投資信託証券)	(2)	(0. 017)	
有価証券取引税	3	0. 032	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託受益証券)	(0)	(0. 000)	
(投資信託証券)	(3)	(0. 032)	
そ の 他 費 用	18	0. 186	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)	(15)	(0. 147)	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)	(3)	(0. 033)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	66	0. 668	

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

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2017年6月16日から2018年6月15日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド	126,248	264,660	985	2,045

（注）単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■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

期首保有額	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

（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	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド	4,691	129,954	286,108

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド	286,108	99.9
コール・ローン等、その他	369	0.1
投資信託財産総額	286,478	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。

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

（注3）ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（16,700.675千円）の投資信託財産総額（16,888,374千円）に対する比率は、98.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	563,216,066円
コール・ローン等	205,708
ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド（評価額）	286,108,769
未収入金	276,901,589
(B) 負債	283,282,373
未払金	279,983,885
未払収益分配金	3,126,671
未払信託報酬	169,745
その他未払費用	2,072
(C) 純資産総額（A－B）	279,933,693
元本	284,242,850
次期繰越損益金	△ 4,309,157
(D) 受益権総口数	284,242,850口
1万口当り基準価額（C／D）	9,848円

* 期首における元本額は10,000,000円、当期中における追加設定元本額は275,571,977円、同解約元本額は1,329,127円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,848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4,309,157円です。

■損益の状況

当期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 30円
支払利息	△ 30
(B) 有価証券売買損益	8,308,457
売買益	15,461,535
売買損	△ 7,153,078
(C) 信託報酬等	△ 204,283
(D) 当期損益金 (A + B + C)	8,104,144
(E) 前期繰越損益金	188,774
(F) 追加信託差損益金	△ 9,475,404
(配当等相当額)	(6,063,638)
(売買損益相当額)	(△ 15,539,042)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 1,182,486
(H) 収益分配金	△ 3,126,671
次期繰越損益金 (G + H)	△ 4,309,157
追加信託差損益金	△ 11,180,861
(配当等相当額)	(4,358,181)
(売買損益相当額)	(△ 15,539,042)
分配準備積立金	6,871,704

- (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	1,880,047円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	6,224,097
(c) 収益調整金	6,063,638
(d) 分配準備積立金	188,774
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	14,356,556
(f) 分配金	3,126,671
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	11,229,885
(h) 受益権総口数	284,242,850口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ
1 万 口 当 り 分 配 金 110円

分配金の課税上の取扱いについて

- 分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- 元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- 普通分配金については、20.315％（所得税15％、復興特別所得税0.315％および地方税5％）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
- 法人の受益者の場合、税率が異なります。
- 税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

《お知らせ》

■マザーファンドにおける先物取引の利用について

当ファンドの主要投資対象である「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」において、不動産投信指数先物取引を利用できるように約款を変更しました。

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワ外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワ S M A 専用））が投資対象としている「ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド」の決算日（2017年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年 6 月15日）現在におけるダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を320～328ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2017年 6 月16日から2018年 6 月15日まで)

買 付				売 付			
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	43.6	382,712	8,777	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	28	237,567	8,484

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2017年 6 月16日から2018年 6 月15日まで)

買 付				売 付			
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	16.3	285,026	17,486	WESTFIELD CORP (オーストラリア)	255.6	185,958	727
UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)	10.04	255,656	25,463	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	1.2	21,898	18,248
PROLOGIS INC (アメリカ)	28.7	198,347	6,911	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA (スペイン)	13.34	20,952	1,570
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	8.1	180,563	22,291	MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I (アメリカ)	15	20,301	1,353
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	7.4	142,291	19,228	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST (カナダ)	4.7	19,954	4,245
WELLTOWER INC (アメリカ)	19.9	139,706	7,020	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA (スペイン)	7.03	14,549	2,069
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	19.8	138,450	6,992	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE (カナダ)	18.9	12,965	686
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	10.5	127,895	12,180	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	0.4	9,522	23,806
VENTAS INC (アメリカ)	18.9	122,919	6,503	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	0.4	8,430	21,075
LINK REIT (香港)	115.5	108,667	940	PROLOGIS INC (アメリカ)	1.2	8,245	6,871

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2018年 6 月15日現在におけるダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド（7,648,262千口）の内容です。

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた外貨建ファンドの明細

(i) 外国投資信託受益証券

フ ァ ン ド 名	2018年 6 月15日現在			
	口 数	評 価 額		比 率
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
(アメリカ) VANGUARD REAL ESTATE ETF	15.6	1,243	137,679	0.8

(注 1) 邦貨換算金額は、2018年 6 月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注 2) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。
(注 3) 評価額の単位未満は切捨て。

(ii) 外国投資信託証券

フ ァ ン ド 名	2018年 6月15日現在			
	口 数	評 価 額		比 率
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
不動産ファンド	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
(シンガポール)				
MANULIFE US REAL ESTATE INV	151.527	133	14,758	0.1
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	9.2	367	40,699	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	10.1	75	8,350	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	13.482	299	33,096	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	13.8	337	37,359	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	18.4	3,094	342,500	2.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	41.547	6,815	754,371	4.5
BOSTON PROPERTIES INC	20.5	2,457	272,000	1.6
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	20.755	859	95,079	0.6
GGP INC	83.877	1,738	192,447	1.1
VORNADO REALTY TRUST	23.064	1,659	183,642	1.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	5.6	110	12,247	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	6.1	180	19,957	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	2.4	65	7,206	0.0
QTS REALTY TRUST INC-CL A	6.4	257	28,497	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	49.2	3,136	347,147	2.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	27.9	522	57,868	0.3
EPR PROPERTIES	8.6	547	60,566	0.4
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1.7	15	1,708	0.0
CITY OFFICE REIT INC	3.8	46	5,156	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	8.333	161	17,883	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8.029	184	20,430	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	5.4	110	12,180	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	8	254	28,201	0.2
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3.1	133	14,763	0.1
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6.6	552	61,127	0.4
FOREST CITY REALTY TRUST- A	35.2	711	78,736	0.5
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	14.1	264	29,307	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2.3	63	7,061	0.0
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4.113	43	4,861	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	97.5	2,079	230,178	1.4
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	33.208	698	77,331	0.5
GRAMERCY PROPERTY TRUST	21.395	590	65,404	0.4
CORESITE REALTY CORP	4.5	485	53,685	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	20.4	719	79,612	0.5
RLJ LODGING TRUST	23.371	523	57,967	0.3
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	26	2,885	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	23.5	357	39,586	0.2
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	5.2	76	8,425	0.1
CYRUSONE INC	12.8	751	83,203	0.5
KIMCO REALTY CORP	56.5	933	103,369	0.6
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1.8	16	1,797	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	27.05	677	74,967	0.4
WHITESTONE REIT	4.4	53	5,897	0.0
TIER REIT INC	6.4	146	16,249	0.1

フ ァ ン ド 名	2018年 6月15日現在			
	口 数	評 価 額		比 率
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	0.237	0	100	0.0
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3	30	3,423	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	26.5	933	103,359	0.6
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17.7	341	37,848	0.2
QUALITY CARE PROPERTIES	11.8	260	28,784	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC	26.5	814	90,161	0.5
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	68.711	418	46,314	0.3
INVITATION HOMES INC	37.897	849	94,039	0.6
JBG SMITH PROPERTIES	12.132	457	50,676	0.3
ALEXANDER & BALDWIN INC	8.433	177	19,609	0.1
CLIPPER REALTY INC	1.4	13	1,538	0.0
GLADSTONE LAND CORP	0.9	11	1,270	0.0
INFREAREIT INC	4.7	97	10,809	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	6	130	14,390	0.1
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2.5	54	6,084	0.0
SPIRIT MTA REIT	5.87	59	6,561	0.0
WASHINGTON PRIME GROUP INC	24.16	188	20,884	0.1
CORECIVIC INC	15.524	328	36,408	0.2
STORE CAPITAL CORP	21.8	585	64,856	0.4
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	12.8	182	20,145	0.1
LIFE STORAGE INC	6.2	578	64,003	0.4
SELECT INCOME REIT	8.2	176	19,494	0.1
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5.4	201	22,305	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	9.982	100	11,081	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	4.2	61	6,851	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	26.5	399	44,259	0.3
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	16.5	279	30,881	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	10.2	321	35,561	0.2
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	15.2	337	37,347	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	12.5	330	36,607	0.2
VENTAS INC	47.579	2,588	286,525	1.7
CARETRUST REIT INC	9.803	163	18,097	0.1
GEO GROUP INC/THE	16.3	406	44,993	0.3
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	40.2	697	77,195	0.5
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	13.1	188	20,878	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	23.387	500	55,341	0.3
UMH PROPERTIES INC	4.2	61	6,861	0.0
IRON MOUNTAIN INC	37.4	1,271	140,699	0.8
TERRENO REALTY CORP	7.1	267	29,617	0.2
VEREIT INC	128.408	929	102,896	0.6
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	58.7	477	52,819	0.3
SUN COMMUNITIES INC	10.6	1,023	113,238	0.7
ACADIA REALTY TRUST	11.111	302	33,498	0.2
ALEXANDER'S INC	0.5	191	21,197	0.1
PROLOGIS INC	71.246	4,589	507,984	3.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13.5	1,723	190,747	1.1
BRANDYWINE REALTY TRUST	23.1	372	41,188	0.2
SAUL CENTERS INC	1.3	65	7,220	0.0
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22.945	124	13,738	0.1

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

フ ァ ン ド 名	2018年 6月15日現在			
	口 数	評 価 額		比 率
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
MACK-CALI REALTY CORP	11.6	228	25,279	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	12.3	1,108	122,740	0.7
COUSINS PROPERTIES INC	55.807	541	59,914	0.4
DDR CORP	19.578	337	37,378	0.2
DUKE REALTY CORP	47.1	1,344	148,831	0.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	4.6	434	48,066	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8.867	2,082	230,462	1.4
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	16	532	58,899	0.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9.7	1,174	130,001	0.8
GETTY REALTY CORP	4.203	111	12,336	0.1
WELLTOWER INC	49.2	2,835	313,876	1.9
HCP INC	62.7	1,496	165,649	1.0
HIGHWOODS PROPERTIES INC	13.7	662	73,298	0.4
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	22	625	69,250	0.4
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	16.7	452	50,071	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	16.575	512	56,760	0.3
KILROY REALTY CORP	13	987	109,337	0.6
LASALLE HOTEL PROPERTIES	14.6	518	57,397	0.3
LIBERTY PROPERTY TRUST	19.6	867	96,057	0.6
LTC PROPERTIES INC	5.1	216	23,944	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	27.7	238	26,427	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15.128	1,465	162,195	1.0
MACERICH CO/THE	14.5	813	90,064	0.5
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11.8	1,082	119,827	0.7
NATL HEALTH INVESTORS INC	5.3	394	43,701	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	20.2	851	94,280	0.6
REALTY INCOME CORP	37.717	1,998	221,207	1.3
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	13.1	358	39,712	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8.6	96	10,708	0.1
PUBLIC STORAGE	20	4,289	474,728	2.8
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2.7	334	36,980	0.2
REGENCY CENTERS CORP	19.52	1,171	129,650	0.8
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	10.1	128	14,275	0.1
ISTAR INC	8.4	91	10,087	0.1
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	11.8	263	29,137	0.2
SL GREEN REALTY CORP	12	1,174	129,947	0.8
SENIOR HOUSING PROP TRUST	31.6	552	61,136	0.4
TAUBMAN CENTERS INC	7.8	435	48,189	0.3
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3.5	76	8,464	0.1
UDR INC	35.6	1,320	146,181	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.6	101	11,209	0.1
WP CAREY INC	14.1	944	104,512	0.6
WASHINGTON REIT	10.4	302	33,519	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	15.4	462	51,151	0.3
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11.3	80	8,879	0.1
AGREE REALTY CORP	3.9	209	23,227	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	26.05	814	90,158	0.5
CUBESMART	23.9	749	82,955	0.5
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	30.126	498	55,216	0.3

フ ァ ン ド 名	2018年6月15日現在			
	口 数	評 価 額		比 率
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
DIGITAL REALTY TRUST INC	27.478	2,929	324,290	1.9
CEDAR REALTY TRUST INC	6.9	30	3,390	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	16.7	1,628	180,270	1.1
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4.475	93	10,376	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	13.3	75	8,317	0.0
KITE REALTY GROUP TRUST	10.55	172	19,126	0.1
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	9.7	149	16,597	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1.5	38	4,276	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	17.9	765	84,714	0.5
EDUCATION REALTY TRUST INC	10.1	407	45,061	0.3
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3.6	67	7,478	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	25.642	314	34,822	0.2
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	6.849	97	10,802	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	48.1	664	73,573	0.4
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13.7	106	11,827	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	20.9	809	89,590	0.5
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	12.5	820	90,826	0.5
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	29.5	383	42,413	0.3
ア メ リ カ ・ ド ル 通 貨 計	口 数 、 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	3,074,141 161 銘柄	105,938 11,725,231	<69.6%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9	119	10,063	0.1
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	12.4	177	15,005	0.1
SLATE RETAIL REIT - U	1.7	21	1,849	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5.3	79	6,699	0.0
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	2.7	36	3,103	0.0
SLATE OFFICE REIT	2.8	21	1,780	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	5.6	63	5,331	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	4.5	38	3,259	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3	159	13,438	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	5.2	54	4,586	0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5.9	64	5,433	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	17.6	212	17,884	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1.7	26	2,219	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5.2	67	5,713	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	8.5	256	21,669	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9.3	395	33,354	0.2
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	10.79	134	11,364	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	18.766	377	31,840	0.2
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	2.3	30	2,564	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	21.4	511	43,095	0.3
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	129	10,897	0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2.8	129	10,960	0.1
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	3.1	80	6,828	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	4.9	63	5,338	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	6	247	20,831	0.1
カナダ・ドル通貨計	口 数 、 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	175,856 25 銘柄	3,499 295,116	<1.8%>

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

フ ァ ン ド 名	2018年 6月15日現在			
	口 数	評 価 額		比 率
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	29.9	81	6,687	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	207.42	228	18,830	0.1
RURAL FUNDS GROUP	31.95	67	5,590	0.0
VIVA ENERGY REIT	56.9	120	9,908	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	22.52	97	8,047	0.0
PROPERTYLINK GROUP	49.06	51	4,251	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	98.45	243	20,068	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	31.83	112	9,325	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	70.71	111	9,162	0.1
INDUSTRIA REIT	11.76	29	2,474	0.0
GDI PROPERTY GROUP	69.12	88	7,301	0.0
SCENTRE GROUP	722.52	3,041	251,040	1.5
ARENA REIT	35.38	79	6,569	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	15.31	49	4,068	0.0
BWP TRUST	63.71	207	17,141	0.1
DEXUS	136.95	1,314	108,503	0.6
GPT GROUP	244.92	1,227	101,268	0.6
INVESTA OFFICE FUND	67.5	347	28,689	0.2
CHARTER HALL RETAIL REIT	43.44	183	15,164	0.1
MIRVAC GROUP	505.6	1,127	93,051	0.6
STOCKLAND	330.36	1,370	113,148	0.7
ABACUS PROPERTY GROUP	40.47	154	12,725	0.1
GOODMAN GROUP	217.51	2,064	170,355	1.0
VICINITY CENTRES	438.51	1,157	95,542	0.6
CHARTER HALL GROUP	62.34	397	32,824	0.2
INGENIA COMMUNITIES GROUP	22.53	60	5,001	0.0
オーストラリア・ドル通貨計	口 数 、 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	3,626.67 26 銘柄	14,016 1,156,744	<6.9%>
(香港)	千口	千香港ドル	千円	%
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	146	798	11,260	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	132	728	10,273	0.1
FORTUNE REIT	188	1,769	24,944	0.1
PROSPERITY REIT	158	513	7,240	0.0
LINK REIT	296	21,134	297,995	1.8
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	106	355	5,006	0.0
CHAMPION REIT	277	1,512	21,325	0.1
香 港 ド ル 通 貨 計	口 数 、 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,303 7 銘柄	26,811 378,045	<2.2%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	124.928	171	14,068	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	66.8	92	7,577	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	283.5	328	27,032	0.2
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	73.9	102	8,443	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	201.45	213	17,552	0.1
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	368.075	603	49,619	0.3
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	325.9	853	70,187	0.4

フ ァ ン ド 名	2018年 6月15日現在			
	口 数	評 価 額		比 率
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
CAPITALAND MALL TRUST	363	736	60,572	0.4
SUNTEC REIT	301	511	42,061	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	271.4	333	27,440	0.2
KEPPEL REIT	235	263	21,635	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	78.46	108	8,900	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	166.5	181	14,918	0.1
ESR-REIT	175.437	84	6,922	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS	97.6	157	12,916	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	72	159	13,079	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	176.9	117	9,669	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	74	113	9,367	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	49.4	129	10,679	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	208.8	65	5,406	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	158.18	306	25,224	0.1
CACHE LOGISTICS TRUST	145.2	111	9,190	0.1
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	250.5	393	32,328	0.2
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	94.9	63	5,226	0.0
SPH REIT	70.5	70	5,795	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	64.9	42	3,467	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	78.1	33	2,792	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	84.8	65	5,402	0.0
QUE HOSPITALITY TRUST	140.673	110	9,077	0.1
シンガポール・ドル通貨計	口 数 、 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,801.803 29 銘柄	6,527 536,554	<3.2%>
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
STRIDE PROPERTY GROUP	40.3	73	5,642	0.0
INVESTORE PROPERTY LTD	23.13	34	2,686	0.0
ARGOSY PROPERTY LTD	109	116	8,972	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	188.73	257	19,818	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	44.56	90	6,958	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	137.75	194	14,994	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	131.17	171	13,219	0.1
ニュージーランド・ドル通貨計	口 数 、 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	674.64 7 銘柄	939 72,293	<0.4%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	313.84	177	26,097	0.2
CAPITAL & REGIONAL PLC	59.27	32	4,737	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	75.35	64	9,503	0.1
REGIONAL REIT LTD	35.96	34	5,010	0.0
NEWRIVER REIT PLC	38.2	110	16,134	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	22.49	23	3,397	0.0
LXI REIT PLC	21.16	23	3,444	0.0
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	7.57	6	1,016	0.0
RDI REIT PLC	173.26	61	8,995	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	101.931	972	142,570	0.8
HANSTEEN HOLDINGS PLC	50.32	54	7,955	0.0
SEGRO PLC	134.14	898	131,808	0.8
HAMMERSON PLC	107.61	576	84,497	0.5

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

フ ァ ン ド 名		2018年 6月15日現在			
		口 数	評 価 額		比 率
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		千口	千イギリス・ポンド	千円	%
UNITE GROUP PLC		35.49	307	45,127	0.3
BRITISH LAND CO PLC		134.84	933	136,847	0.8
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		37.001	260	38,143	0.2
INTU PROPERTIES PLC		117.04	225	33,111	0.2
DERWENT LONDON PLC		14.95	458	67,180	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		95.87	109	16,056	0.1
WORKSPACE GROUP PLC		15.5	174	25,619	0.2
SAFESTORE HOLDINGS PLC		28.24	162	23,897	0.1
SHAFTESBURY PLC		33.35	310	45,585	0.3
BIG YELLOW GROUP PLC		19.3	189	27,852	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		89.22	167	24,612	0.1
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		58.83	37	5,427	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC		193.33	298	43,834	0.3
イギリス・ポンド通貨計	口 数 、 金 額	2,014.062	6,671	978,466	
	銘柄 数 < 比 率 >	26 銘柄			<5.8%>
(イスラエル)		千口	千イスラエル・シェケル	千円	%
REIT 1 LTD		9.34	136	4,186	0.0
イスラエル・シェケル通貨計	口 数 、 金 額	9.34	136	4,186	
	銘柄 数 < 比 率 >	1 銘柄			<0.0%>
ユーロ (アイルランド)		千口	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		40.86	54	7,002	0.0
GREEN REIT PLC		89.97	137	17,605	0.1
HIBERNIA REIT PLC		86.69	132	16,986	0.1
国 小 計	口 数 、 金 額	217.52	325	41,595	
	銘柄 数 < 比 率 >	3 銘柄			<0.2%>
ユーロ (オランダ)		千口	千ユーロ	千円	%
WERELDHAVE NV		5.2	172	22,060	0.1
EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV		6.41	231	29,546	0.2
NSI NV		2.391	86	11,116	0.1
VASTNED RETAIL NV		2.05	83	10,697	0.1
国 小 計	口 数 、 金 額	16.051	574	73,421	
	銘柄 数 < 比 率 >	4 銘柄			<0.4%>
ユーロ (ベルギー)		千口	千ユーロ	千円	%
AEDIFICA		2.408	190	24,392	0.1
COFINIMMO		2.65	285	36,537	0.2
BEFIMMO		2.97	155	19,904	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		1.74	37	4,751	0.0
RETAIL ESTATES		0.98	75	9,714	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA		2.16	229	29,394	0.2
国 小 計	口 数 、 金 額	12.908	974	124,694	
	銘柄 数 < 比 率 >	6 銘柄			<0.7%>
ユーロ (フランス)		千口	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL GROUP STAPLED		18.17	3,479	445,035	2.6
ICADE		5.99	492	62,975	0.4
ALTAREA		0.47	93	12,010	0.1

フ ァ ン ド 名		2018年 6月15日現在			
		口 数	評 価 額		比 率
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		千口	千ユーロ	千円	%
GECINA SA		6.451	926	118,481	0.7
KLEPIERRE		27.8	927	118,686	0.7
COVIVIO		7.26	650	83,198	0.5
MERCIALYS		7.05	108	13,895	0.1
国 小 計	口 数 、 金 額	73.191	6,679	854,282	
	銘柄 数 < 比 率 >	7 銘柄			<5.1%>
ユーロ (ドイツ)		千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		18.7	243	31,164	0.2
HAMBORNER REIT AG		10.68	99	12,662	0.1
国 小 計	口 数 、 金 額	29.38	342	43,826	
	銘柄 数 < 比 率 >	2 銘柄			<0.3%>
ユーロ (スペイン)		千口	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		11.97	110	14,069	0.1
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		43.16	403	51,613	0.3
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI		14.09	248	31,789	0.2
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		1.29	21	2,804	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		44.69	538	68,933	0.4
国 小 計	口 数 、 金 額	115.2	1,322	169,210	
	銘柄 数 < 比 率 >	5 銘柄			<1.0%>
ユーロ (イタリア)		千口	千ユーロ	千円	%
BENI STABILI SPA		127.41	97	12,417	0.1
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		6.24	45	5,785	0.0
国 小 計	口 数 、 金 額	133.65	142	18,202	
	銘柄 数 < 比 率 >	2 銘柄			<0.1%>
ユ ー ロ 通 貨 計		口 数 、 金 額	10,361	1,325,233	
		銘柄 数 < 比 率 >	29 銘柄		<7.9%>
合 計	口 数 、 金 額	16,277.412	—	16,471,872	
	銘柄 数 < 比 率 >	311 銘柄			<97.8%>

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

(注 2) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

(注 3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2)先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘 柄 別		2018年 6月15日現在	
		買 建 額	売 建 額
外 国	DJ US REIT IDXFTRS (アメリカ)	141 百万円	— 百万円
	STOXX600 REIT IDXFTR (ドイツ)	22	—

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

(注 2) 単位未満は切捨て。

ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド

運用報告書 第13期（決算日 2017年11月30日）

（計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日）

ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンドの第13期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針	S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行います。
主 要 投 資 対 象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）
運 用 方 法	①主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 ②組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。 ③運用の効率化を図るため、不動産投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。 ④保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
投 資 信 託 証 券 組 入 制 限	無制限

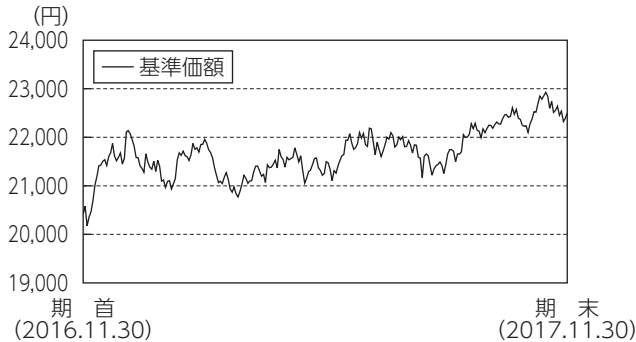
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	円	%	円	%	%	%	%
(期首)2016年11月30日	20,411	—	23,209	—	—	98.9	—
12月末	21,569	5.7	24,465	5.4	—	98.4	—
2017年1月末	21,097	3.4	23,979	3.3	—	98.9	—
2月末	21,851	7.1	24,778	6.8	—	99.2	—
3月末	21,215	3.9	23,966	3.3	—	99.0	—
4月末	21,542	5.5	24,499	5.6	—	98.9	—
5月末	21,217	3.9	24,180	4.2	—	99.6	—
6月末	21,851	7.1	25,059	8.0	—	99.1	—
7月末	21,805	6.8	25,045	7.9	0.3	99.1	—
8月末	21,658	6.1	24,700	6.4	0.2	99.0	—
9月末	22,181	8.7	25,341	9.2	0.6	98.3	—
10月末	22,101	8.3	25,276	8.9	0.4	98.7	0.6
(期末)2017年11月30日	22,500	10.2	25,699	10.7	0.3	98.9	0.5

- (注1) 騰落率は期首比。
 (注2) S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) は、S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。
 (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
 (注4) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：20,411円 期末：22,500円 騰落率：10.2%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市場の上昇が主な要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市場

北米リート市場は、期首より、米国トランプ政権の景気刺激策への期待から緩やかな上昇となりました。2017年3月には、長期金利が上昇ペースを速めたことを受けて一時売られました。その後は、米国景気の底堅さやトランプ政権に対する政策期待などの好材料もある一方、利上げ懸念や対北朝鮮をはじめとした地政学リスクもあって方向感のない動きとなりました。期末にかけては、米国経

済の先行きに楽観的な見方が強まったことや、長期金利の上昇がー服したことを受け、上昇して期末を迎えました。

欧州リート市場は、期首から、長期金利の影響を受けた一進一退の値動きとなりました。2017年4月から5月にかけては、フランス大統領選挙の結果を受けた安心感から大きく上昇しました。その後は、英国の総選挙の結果を受けて政策の不透明感が高まったことや、ドイツを中心とした長期金利上昇が嫌気され下落する局面はあったものの、期末にかけてはやや買い戻される展開となりました。

アジア・オセアニアリート市場は、期首より、香港およびシンガポールは長期金利上昇の影響や中国政府が不動産市場の投機抑制に動いたことから、軟調な推移となりました。2017年に入ると、目金金利が低下に転じたことなどを好感し、上昇基調となりました。その後も、上昇を続ける中国株式市場の影響やリートの好業績への期待から、堅調に推移しました。オーストラリアは、期首から、好調な国内景気を背景に買われました。2017年6月には、テナント売り上げの減少懸念があった商業リートを中心に売られる局面はあったものの、主要リートの好業績等もあり、期末にかけて堅調に推移しました。

○為替相場

為替相場は、期を通じてユーロなどの欧州の通貨が対円で上昇しました。

米ドルは、期首から、トランプ大統領の政策への期待と米国の年内追加利上げ観測の高まりによる日米金利差拡大を背景に上昇しました。2017年に入ると、トランプ政権が日本を含めた通貨安批判を行なったことを材料に緩やかな円高に転じました。4月後半からは、米国の金利先高感が強まった局面では円安が進むものの、政治的リスクが高まった局面では円高となるボックス圏の推移となりました。

ユーロは、2017年3月にフランス大統領選挙の動向をにらんで一時的に売られましたが、最終的にEU (欧州連合) に肯定的な候補が大統領に選出されたことから、上昇に転じました。その後も、ECB (欧州中央銀行) が金融緩和姿勢を後退させたことから、ユーロは9月までは上昇を続けました。英ポンドは、EU離脱による経済的な懸念が強まり2017年4月中旬までは英ポンド安が進みましたが、その後はユーロと同様に英ポンド高基調となりました。

オーストラリア・ドルは、2017年3月から4月にかけて資源価格の下落などで一時軟調な局面はあったものの、その後は相対的な高金利や資源価格が上昇に転じたことが好感されて、オーストラリア・ドル高となりました。期末にかけては、金利据え置き観測の高まりから下落する展開となりました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

また、運用の効率化を図るため、外国投資信託 (ETF) および不動産投信指数先物を組み入れました。

◆ベンチマークとの差異について

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

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

《今後の運用方針》

今後の運用につきましては、引き続き、海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ETF）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

S & P先進国REIT指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「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 (先物)	6円 (0)
(投資信託受益証券)	(0)
(投資信託証券)	(5)
有価証券取引税 (投資信託受益証券)	8 (0)
(投資信託証券)	(8)
その他費用 (保管費用)	42 (43)
(その他)	(△1)
合 計	55

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

■ 売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 8.8 (-)	千アメリカ・ドル 735 (-)	千口 4 (-)	千アメリカ・ドル 331 (-)

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

(2) 投資信託証券

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 1,440.1 (△ 4,826)	千アメリカ・ドル 51,308 (△ 165)	千口 52 (-)	千アメリカ・ドル 1,993 (-)
	カナダ	千口 86.8 (△ 3.5)	千カナダ・ドル 1,625 (△ 74)	千口 3.3 (-)	千カナダ・ドル 14 (-)
	オーストラリア	千口 1,740.1 (△ 4.31)	千オーストラリア・ドル 7,125 (△ 28)	千口 61.59 (-)	千オーストラリア・ドル 211 (-)
	香港	千口 581.5 (-)	千香港ドル 10,029 (-)	千口 71.5 (-)	千香港ドル 319 (-)
	シンガポール	千口 2,075.9 (35,275)	千シンガポール・ドル 2,798 (18)	千口 84.15 (-)	千シンガポール・ドル 104 (-)
	ニュージーランド	千口 294.06 (-)	千ニュージーランド・ドル 396 (-)	千口 35.31 (-)	千ニュージーランド・ドル 56 (-)
	イギリス	千口 908.86 (38,843)	千イギリス・ポンド 2,957 (△ 7)	千口 69.79 (-)	千イギリス・ポンド 164 (-)
	イスラエル	千口 3.55 (-)	千イスラエル・シェケル 39 (-)	千口 - (-)	千イスラエル・シェケル - (-)
	ユーロ (アイルランド)	千口 95.7 (-)	千ユーロ 130 (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)
	ユーロ (オランダ)	千口 12.61 (△ 10,369)	千ユーロ 266 (-)	千口 0.27 (-)	千ユーロ 10 (-)
国	ユーロ (ベルギー)	千口 6.04 (0.238)	千ユーロ 422 (13)	千口 1.29 (-)	千ユーロ 74 (-)
	ユーロ (フランス)	千口 30.57 (0.491)	千ユーロ 2,678 (49)	千口 0.18 (-)	千ユーロ 37 (-)
	ユーロ (ドイツ)	千口 12.91 (-)	千ユーロ 141 (△ 4)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)
	ユーロ (スペイン)	千口 43.63 (-)	千ユーロ 490 (△ 5)	千口 13.34 (-)	千ユーロ 157 (-)
	ユーロ (イタリア)	千口 67.57 (-)	千ユーロ 45 (△ 0)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)
	ユーロ (ユーロ 通貨計)	千口 269.03 (△ 9.64)	千ユーロ 4,175 (53)	千口 15.08 (-)	千ユーロ 280 (-)
	(注1) 金額は受渡し代金。 (注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分、上段の数字には含まれておりません。 (注3) 売付()内は償還による減少分、上段の数字には含まれておりません。 (注4) 金額の単位未満は切捨て。				
	(注1) 金額は受渡し代金。 (注2) 単位未満は切捨て。				

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円 72	百万円 -	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
VANGUARD REIT ETF (アメリカ)	千口 8.8	千円 82,211	円 9,342	VANGUARD REIT ETF (アメリカ)	千口 4	千円 37,283	円 9,320

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	千口 19.5	千円 372,163	円 19,085	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	千口 1.5	千円 28,176	円 18,784
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	9.2	222,939	24,232	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA (スペイン)	13.34	20,952	1,570
PROLOGIS INC (アメリカ)	33	207,978	6,302	MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I (アメリカ)	15	20,301	1,353
WELLTOWER INC (アメリカ)	22.8	178,226	7,816	REGENCY CENTERS CORP (アメリカ)	2.2	16,089	7,313
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	8.6	177,118	20,595	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	0.6	12,262	20,437
UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)	6.18	168,889	27,328	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	0.5	11,960	23,920
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	22.6	164,768	7,290	PROLOGIS INC (アメリカ)	1.7	11,209	6,593
VENTAS INC (アメリカ)	21.7	156,882	7,229	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	1.3	9,528	7,329
BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)	9.3	133,440	14,348	NEW YORK REIT INC (アメリカ)	7.7	8,452	1,097
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	10.4	129,011	12,404	WELLTOWER INC (アメリカ)	1	8,053	8,053

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

(1) 外国投資信託受益証券

ファンド名	当		期		末
	口数	評価額	評価額	比率	
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%	
VANGUARD REIT ETF	4.8	404	45,318	0.3	

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

(2) 外国投資信託証券

ファ ン ド 名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド				
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
MANULIFE US REAL ESTATE INV	93.103	84	9,441	0.1
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	7.1	269	30,239	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	7.7	63	7,109	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	10.882	279	31,336	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	10.9	239	26,845	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	14.2	2,584	289,645	2.2
SIMON PROPERTY GROUP INC	32.147	5,102	571,756	4.3
BOSTON PROPERTIES INC	15.9	1,988	222,788	1.7
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	16.055	711	79,676	0.6
GGP INC	63.977	1,497	167,745	1.3
VORNADO REALTY TRUST	17.664	1,358	152,263	1.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	4.5	95	10,659	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	4.6	121	13,658	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	1.6	46	5,161	0.0
QTS REALTY TRUST INC-CL A	4.8	269	30,194	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	37.8	2,522	282,676	2.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	21.4	414	46,494	0.3
EPR PROPERTIES	6.5	439	49,256	0.4
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1.7	19	2,163	0.0
CITY OFFICE REIT INC	2.1	28	3,138	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	6.333	137	15,384	0.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	6.329	167	18,757	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	4.5	102	11,435	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	6	173	19,409	0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	2.2	90	10,106	0.1
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5.2	361	40,471	0.3
FOREST CITY REALTY TRUST- A	27.3	668	74,883	0.6
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	10.9	214	24,060	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1.6	45	5,123	0.0
ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	2.213	20	2,308	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	76.5	1,504	168,607	1.3
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	25.908	563	63,169	0.5
GRAMERCY PROPERTY TRUST	15.995	454	50,881	0.4
CORESITE REALTY CORP	3.5	394	44,174	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	15.9	565	63,406	0.5
RLJ LODGING TRUST	17.271	368	41,316	0.3
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	26	2,947	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	18	326	36,586	0.3
ARMADA HOFFER PROPERTIES IN	3.8	59	6,625	0.0
CYRUSONE INC	9.3	557	62,513	0.5
KIMCO REALTY CORP	43.4	801	89,819	0.7
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1.8	17	1,938	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AVE-CL A	20.45	624	70,025	0.5
WHITESTONE REIT	3	44	5,011	0.0
TIER REIT INC	4.5	89	10,064	0.1
WHEELER REAL ESTATE INVESTME	0.237	2	269	0.0
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3	33	3,791	0.0

ファ ン ド 名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	20.4	725	81,238	0.6
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14.4	285	32,028	0.2
QUALITY CARE PROPERTIES	9.3	137	15,422	0.1
PARK HOTELS & RESORTS INC	14.3	413	46,306	0.3
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	56.211	691	77,470	0.6
INVITATION HOMES INC	29.297	688	77,176	0.6
JBG SMITH PROPERTIES	9.232	307	34,467	0.3
ALEXANDER & BALDWIN INC	4.6	133	15,004	0.1
CLIPPER REALTY INC	1.4	14	1,600	0.0
GLADSTONE LAND CORP	0.9	12	1,357	0.0
INFREAREIT INC	3.7	78	8,830	0.1
WASHINGTON PRIME GROUP INC	18.36	134	15,017	0.1
CORECIVIC INC	11.824	276	30,935	0.2
STORE CAPITAL CORP	16.8	433	48,548	0.4
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	10	149	16,796	0.1
LIFE STORAGE INC	4.8	429	48,125	0.4
SELECT INCOME REIT	6.4	162	18,164	0.1
AMERICAN ASSETS TRUST INC	4.2	166	18,702	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	7.782	81	9,077	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	3.1	67	7,520	0.1
PARAMOUNT GROUP INC	20.1	322	36,080	0.3
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	13.1	266	29,870	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	8	248	27,833	0.2
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	12.4	283	31,817	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	9.5	268	30,113	0.2
VENTAS INC	36.579	2,343	262,602	2.0
CARETRUST REIT INC	7.203	132	14,874	0.1
GEO GROUP INC/THE	12.8	339	38,079	0.3
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	30.9	563	63,153	0.5
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	9.6	178	20,050	0.2
SABRA HEALTH CARE REIT INC	17.787	343	38,485	0.3
UMH PROPERTIES INC	2.9	45	5,069	0.0
IRON MOUNTAIN INC	27.3	1,106	123,949	0.9
TERRENO REALTY CORP	5.4	203	22,786	0.2
VEREIT INC	98.808	775	86,910	0.7
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	46.7	395	44,268	0.3
SUN COMMUNITIES INC	8.1	750	84,144	0.6
ACADIA REALTY TRUST	8.611	246	27,643	0.2
ALEXANDER'S INC	0.4	170	19,086	0.1
PROLOGIS INC	55.046	3,640	407,883	3.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9.7	1,231	138,001	1.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	17.4	302	33,846	0.3
SAUL CENTERS INC	1	64	7,203	0.1
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	15.945	92	10,380	0.1
MACK-CALI REALTY CORP	8.5	190	21,324	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	9.4	860	96,468	0.7
COUSINS PROPERTIES INC	41.607	373	41,865	0.3
DDR CORP	31.156	243	27,299	0.2
DUKE REALTY CORP	36.5	1,045	117,173	0.9

ファンド名	当 期 末			
	口 数	外貨建金額	評価額	比率
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
EASTGROUP PROPERTIES INC	3.4	318	35,647	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,767	1,676	187,801	1.4
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	11.9	384	43,095	0.3
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7.4	977	109,533	0.8
GETTY REALTY CORP	2,803	79	8,954	0.1
WELLTOWER INC	37.9	2,549	285,717	2.1
HCP INC	48.1	1,293	144,980	1.1
HIGHWOODS PROPERTIES INC	10.6	537	60,253	0.5
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	16.9	504	56,525	0.4
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	12.3	402	45,081	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	12,375	375	42,056	0.3
KILROY REALTY CORP	10.1	762	85,398	0.6
LASALLE HOTEL PROPERTIES	11.2	316	35,452	0.3
LIBERTY PROPERTY TRUST	15	669	74,995	0.6
LTC PROPERTIES INC	4.1	190	21,302	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	22.4	234	26,278	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,728	1,199	134,369	1.0
MACERICH CO/THE	11.2	719	80,606	0.6
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8.9	797	89,393	0.7
NATL HEALTH INVESTORS INC	4.2	329	36,876	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	15.3	632	70,923	0.5
REALTY INCOME CORP	28,317	1,570	176,001	1.3
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	10.1	308	34,573	0.3
PENN REAL ESTATE INVEST TST	6.6	79	8,903	0.1
PUBLIC STORAGE	15.4	3,238	362,818	2.7
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2	264	29,639	0.2
REGENCY CENTERS CORP	15.22	1,034	115,967	0.9
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	7.3	106	11,917	0.1
ISTAR INC	6.5	75	8,404	0.1
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	9.1	228	25,603	0.2
SL GREEN REALTY CORP	10.2	1,042	116,839	0.9
SENIOR HOUSING PROP TRUST	24.1	461	51,712	0.4
TAUBMAN CENTERS INC	6.2	356	39,987	0.3
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2.5	59	6,652	0.0
UDR INC	27.7	1,090	122,164	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.1	82	9,282	0.1
WP CAREY INC	11	782	87,634	0.7
WASHINGTON REIT	7.8	252	28,308	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	12.4	409	45,850	0.3
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	8.3	54	6,147	0.0
AGREE REALTY CORP	2.6	128	14,394	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20.25	542	60,809	0.5
CUBESMART	18.5	524	58,788	0.4
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	22,326	370	41,527	0.3
DIGITAL REALTY TRUST INC	21,178	2,477	277,616	2.1
CEDAR REALTY TRUST INC	6.9	41	4,685	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	13	1,105	123,902	0.9
HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,475	61	6,876	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	10.1	61	6,858	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	8.25	162	18,201	0.1

ファンド名	当 期 末			
	口 数	外貨建金額	評価額	比率
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	7	124	13,898	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1.5	40	4,538	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	14	594	66,622	0.5
EDUCATION REALTY TRUST INC	7.2	264	29,624	0.2
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2.5	57	6,479	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	20,442	225	25,287	0.2
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	5,249	76	8,545	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	36.9	508	57,016	0.4
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	9.7	104	11,705	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	15.5	624	69,957	0.5
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	9.5	570	63,974	0.5
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	22.9	297	33,382	0.3
アメリカ・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	2,337,492 158銘柄	84,388 9,455,753	<70.9%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7.7	107	9,402	0.1
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	8.9	103	9,007	0.1
SLATE RETAIL REIT - U	1.7	22	1,946	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	3.5	48	4,252	0.0
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE	0.7	8	719	0.0
SLATE OFFICE REIT	2.8	22	1,990	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	5.6	63	5,560	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	2.4	17	1,546	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	2.2	111	9,671	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	2.5	21	1,914	0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3.5	31	2,707	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	4.3	56	4,947	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	13.8	92	8,017	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1.7	25	2,179	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2.9	42	3,702	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	6.6	192	16,762	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTATE	6.8	251	21,920	0.2
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	3.9	176	15,401	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	9.49	132	11,572	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	14,266	299	26,069	0.2
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	2.3	31	2,772	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16.1	400	34,861	0.3
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4.2	90	7,883	0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2	80	6,980	0.1
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	2.3	57	5,044	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3.7	50	4,434	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	4.8	199	17,408	0.1
カナダ・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	140,656 27銘柄	2,740 238,677	< 1.8%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	16.89	48	4,157	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	119.72	123	10,465	0.1
RURAL FUNDS GROUP	23.54	56	4,774	0.0
VIVA ENERGY REIT	39.3	85	7,271	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	13.99	59	5,010	0.0

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ファンド名	当期末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
PROPERTYLINK GROUP	49.06	50	4,246	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	74.35	178	15,144	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUST	26.19	91	7,779	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	44.14	72	6,124	0.0
INDUSTRIA REIT	11.76	30	2,604	0.0
GDI PROPERTY GROUP	41.86	54	4,600	0.0
SCENTRE GROUP	553.46	2,341	198,692	1.5
ARENA REIT	27.01	67	5,730	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	10	32	2,749	0.0
BWP TRUST	45.99	146	12,412	0.1
DEXUS	105.66	1,078	91,556	0.7
GPT GROUP	184.96	989	83,981	0.6
INVESTA OFFICE FUND	50.66	239	20,336	0.2
CHARTER HALL RETAIL REIT	33.79	142	12,130	0.1
MIRVAC GROUP	381.83	931	79,070	0.6
STOCKLAND	250.6	1,172	99,536	0.7
WESTFIELD CORP	199.18	1,665	141,320	1.1
ABACUS PROPERTY GROUP	30.29	125	10,642	0.1
GOODMAN GROUP	165	1,437	121,970	0.9
VICINITY CENTRES	336.69	935	79,438	0.6
CHARTER HALL GROUP	46.45	291	24,757	0.2
INGENIA COMMUNITIES GROUP	16.33	45	3,839	0.0
オーストラリア・ドル 通 貨 計	2,898.7	12,493	1,060,346	< 8.0%>
(香港)	千口	千香港ドル	千円	%
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	103	535	7,685	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	91	486	6,986	0.1
FORTUNE REIT	140	1,358	19,487	0.1
PROSPERITY REIT	124	409	5,872	0.0
LINK REIT	232	16,321	234,209	1.8
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	74	256	3,674	0.0
CHAMPION REIT	196	1,136	16,313	0.1
香港ドル 通 貨 計	960	20,503	294,227	< 2.2%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	74.028	106	8,868	0.1
FIRST REAL ESTATE INVST TRST	53.4	73	6,086	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	175.5	203	16,935	0.1
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	48.9	66	5,532	0.0
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	120.3	129	10,808	0.1
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	269.975	502	41,774	0.3
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	251.3	660	54,981	0.4
CAPITALAND MALL TRUST	274.5	565	47,041	0.4
SUNTEC REIT	229.3	458	38,150	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	211.9	266	22,211	0.2
KEPPEL REIT	184.7	230	19,206	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	52.76	75	6,320	0.0
ASCOTT RESIDENCE TRUST	134.3	158	13,183	0.1
ESR-REIT	84.479	47	3,970	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS	76.4	124	10,359	0.1

ファンド名	当期末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
FRASERS CENTREPOINT TRUST	54.4	120	10,001	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	126.9	96	8,023	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	51.1	84	7,014	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	36.3	103	8,636	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	165.2	68	5,703	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	119.38	235	19,564	0.1
CACHE LOGISTICS TRUST	100.2	86	7,168	0.1
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	190.6	297	24,735	0.2
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	70.2	50	4,204	0.0
SPH REIT	70.5	74	6,158	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	64.9	42	3,536	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	78.1	32	2,696	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	64.2	53	4,486	0.0
OUE HOSPITALITY TRUST	96.673	79	6,594	0.0
シンガポール・ドル 通 貨 計	3,530.395	5,096	423,954	< 3.2%>
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
STRIDE PROPERTY GROUP	29.16	51	3,980	0.0
INVESTORE PROPERTY LTD	10.25	14	1,108	0.0
ARGOSY PROPERTY LTD	71.63	75	5,767	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD	145.35	198	15,213	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	25.97	57	4,371	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	107.55	146	11,215	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	100.59	132	10,181	0.1
ニュージーランド・ドル 通 貨 計	490.5	676	51,837	< 0.4%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	185.42	109	16,473	0.1
CAPITAL & REGIONAL PLC	41.94	21	3,231	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	51.71	46	6,918	0.1
REGIONAL REIT LTD	26.15	27	4,088	0.0
NEWWRIVER REIT PLC	31.4	99	14,939	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	13.45	15	2,259	0.0
LXI REIT PLC	11.54	12	1,804	0.0
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	7.57	7	1,165	0.0
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	110.39	41	6,166	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	77.831	723	108,813	0.8
HANSTEEN HOLDINGS PLC	42.78	58	8,862	0.1
SEGRO PLC	104.09	571	85,984	0.6
HAMMERSON PLC	82.18	424	63,809	0.5
UNITE GROUP PLC	24.52	176	26,466	0.2
BRITISH LAND CO PLC	108.08	674	101,385	0.8
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	32.79	200	30,068	0.2
INTU PROPERTIES PLC	87.71	170	25,672	0.2
DERWENT LONDON PLC	11.52	313	47,122	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	56.76	65	9,812	0.1
WORKSPACE GROUP PLC	12.28	114	17,195	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	20.18	93	14,045	0.1
SHAFTESBURY PLC	23.03	227	34,188	0.3

ファン ド 名	当 期 末			
	口 数	評 価 額	比 率	
		外貨建金額 邦貨換算金額		
BIG YELLOW GROUP PLC	千口 15.46	千円 129 19,406	% 0.1	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	70.52	126 19,082	0.1	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	43.33	26 3,940	0.0	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	141.22	205 30,825	0.2	
(非上場)				
ASSURA PLC-ENT	33.712	— —	—	
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額 1,467,563 銘柄数<比率> 27銘柄	4,681 703,728	< 5.3%>	
(イスラエル)				
REIT 1 LTD	千口 9.34	千円 140 4,480	% 0.0	
イスラエル・シェケル通貨計	口数、金額 9.34 銘柄数<比率> 1銘柄	140 4,480	< 0.0%>	
ユーロ (アイルランド)				
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	千口 33.1	千ユーロ 49 6,545	% 0.0	
GREEN REIT PLC	66.56	99 13,171	0.1	
HIBERNIA REIT PLC	70.99	100 13,340	0.1	
国 小 計	口数、金額 170.65 銘柄数<比率> 3銘柄	248 33,057	< 0.2%>	
ユーロ (オランダ)				
WERELDHAVE NV	千口 4.15	千ユーロ 161 21,473	% 0.2	
EUROCOMMERCIAL PROPRIET-CV	5.01	177 23,574	0.2	
NSI NV	1.731	58 7,793	0.1	
VASTNED RETAIL NV	1.48	59 7,842	0.1	
国 小 計	口数、金額 12.371 銘柄数<比率> 4銘柄	456 60,683	< 0.5%>	
ユーロ (ベルギー)				
AEDIFICA	千口 1.808	千ユーロ 144 19,221	% 0.1	
COFINIMMO	1.97	212 28,282	0.2	
BEFIMMO	2.31	123 16,425	0.1	
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	1.23	27 3,609	0.0	
RETAIL ESTATES	0.5	36 4,801	0.0	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	1.67	151 20,089	0.2	
国 小 計	口数、金額 9.488 銘柄数<比率> 6銘柄	695 92,430	< 0.7%>	
ユーロ (フランス)				
UNIBAIL-RODAMCO SE	千口 10.4	千ユーロ 2,260 300,278	% 2.3	
ICADE	4.69	369 49,095	0.4	
ALTAREA	0.35	67 8,989	0.1	
GECINA SA	4.831	672 89,311	0.7	
KLEPIERRE	21.62	748 99,377	0.7	
FONCIERE DES REGIONS	5.48	489 64,992	0.5	
MERCIALYS	5.66	98 13,109	0.1	
国 小 計	口数、金額 53.031 銘柄数<比率> 7銘柄	4,707 625,154	< 4.7%>	
ユーロ (ドイツ)				
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	千口 12.69	千ユーロ 158 21,007	% 0.2	
HAMBORNER REIT AG	8.12	78 10,409	0.1	
国 小 計	口数、金額 20.81 銘柄数<比率> 2銘柄	236 31,417	< 0.2%>	

ファン ド 名	当 期 末			
	口 数	評 価 額	比 率	
		外貨建金額 邦貨換算金額		
ユーロ (スペイン)				
IAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	千口 9.6	千ユーロ 79 10,592	% 0.1	
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	11.17	164 21,799	0.2	
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	6.96	127 16,906	0.1	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	34.56	379 50,374	0.4	
国 小 計	口数、金額 62.29 銘柄数<比率> 4銘柄	750 99,673	< 0.7%>	
ユーロ (イタリア)				
BENI STABILI SPA	千口 94.42	千ユーロ 71 9,524	% 0.1	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZI	30.4	32 4,356	0.0	
国 小 計	口数、金額 124.82 銘柄数<比率> 2銘柄	104 13,880	< 0.1%>	
ユーロ通貨計	口数、金額 453.46 銘柄数<比率> 28銘柄	7,200 956,298	< 7.2%>	
合 計	口数、金額 12,288.106 銘柄数<比率> 311銘柄	— 13,189,304	< 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。

(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 DJ US REIT IDXFTS (アメリカ)	百万円 72	百万円 —

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	45,318	0.3
投資信託証券	13,189,304	98.4
コール・ローン等、その他	172,362	1.3
投資信託財産総額	13,406,985	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝112.05円、1カナダ・ドル＝87.10円、1オーストラリア・ドル＝84.87円、1香港ドル＝14.35円、1シンガポール・ドル＝83.19円、1ニュージーランド・ドル＝76.68円、1イギリス・ポンド＝150.33円、1イスラエル・シェケル＝31.98円、1ユーロ＝132.81円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（13,288,169千円）の投資信託財産総額（13,406,985千円）に対する比率は、99.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	13,434,206,898円
コール・ローン等	128,633,646
投資信託受益証券(評価額)	45,318,398
投資信託証券(評価額)	13,189,304,705
未収入金	27,764,698
未収配当金	29,756,258
差入委託証拠金	13,429,193
(B) 負債	96,531,802
未払金	91,221,802
未払解約金	5,310,000
(C) 純資産総額(A－B)	13,337,675,096
元本	5,927,845,320
次期繰越損益金	7,409,829,776
(D) 受益権総口数	5,927,845,320口
1万口当り基準価額(C／D)	22,500円

* 期首における元本額は2,563,048,197円、当期中における追加設定元本額は3,788,132,970円、同解約元本額は423,335,847円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）3,020,027,986円、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）385,272,511円、ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）197,879,052円、ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）138,768,817円、D－I’s グローバルREITインデックス1,191,716円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 28,535円、iFree 外国REITインデックス61,854,354円、iFree 8資産バランス305,935,202円、DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド1,494,626,508円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 3,528,717円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 6,075,115円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 1,124,043円、ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT 280,050,632円、ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド22,439,317円、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）4,479,909円、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）4,562,906円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は22,500円です。

■損益の状況

当期 自2016年12月1日 至2017年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	373,343,266円
受取配当金	373,355,931
受取利息	27,447
支払利息	△ 40,112
(B) 有価証券売買損益	485,032,529
売買益	900,668,253
売買損	△ 415,635,724
(C) 先物取引等損益	392,175
取引益	392,175
(D) その他費用	△ 19,421,346
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	839,346,624
(F) 前期繰越損益金	2,668,328,775
(G) 解約差損益金	△ 499,757,653
(H) 追加信託差損益金	4,401,912,030
(I) 合計(E + F + G + H)	7,409,829,776
次期繰越損益金(I)	7,409,829,776

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

《お知らせ》
■先物取引の利用について
不動産投信指数先物取引を利用できるように約款を変更しました。

先進国 R E I T マザーファンド

運用報告書 第 5 期 (決算日 2018 年 5 月 8 日)

(計算期間 2017 年 5 月 9 日～2018 年 5 月 8 日)

先進国 R E I T マザーファンドの第 5 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	イ. 先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）または店頭登録（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および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ. 先進国のリート指数を対象指数とした E T F（上場投資信託証券） ハ. 先進国のリートを対象としたリート指数先物取引 ニ. 国内の債券
運 用 方 法	①主として、先進国のリート、先進国のリート指数を対象指数とした E T F、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引および残存期間の短いわが国の債券に投資し、先進国のリート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。 ※一部日本のリートを含む指数を対象とする E T F を組み入れる場合があります。 ②運用の効率化を図るため、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引を利用することがあります。このため、リートおよび E T F の組入総額ならびにリート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。 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	無制限

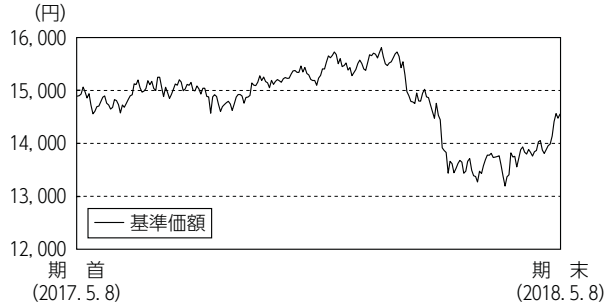
大和投資信託

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、配当込み、円ベース)		投資信託 証 券	不動産投信 指数先物
		騰落率	(参考指数)	騰落率	組入比率	比 率
(期 首)2017年 5月 8日	円 14, 893	% —	16, 214	% —	% 97. 2	% —
5月末	14, 649	△ 1. 6	15, 997	△ 1. 3	97. 0	—
6月末	15, 038	1. 0	16, 579	2. 3	97. 2	2. 0
7月末	15, 003	0. 7	16, 570	2. 2	97. 6	1. 6
8月末	14, 875	△ 0. 1	16, 342	0. 8	97. 9	1. 7
9月末	15, 170	1. 9	16, 766	3. 4	96. 3	3. 0
10月末	15, 098	1. 4	16, 723	3. 1	97. 1	2. 6
11月末	15, 397	3. 4	17, 003	4. 9	97. 4	2. 2
12月末	15, 728	5. 6	17, 392	7. 3	95. 8	3. 7
2018年 1月末	14, 474	△ 2. 8	16, 101	△ 0. 7	96. 3	2. 9
2月末	13, 493	△ 9. 4	15, 017	△ 7. 4	95. 5	3. 9
3月末	13, 743	△ 7. 7	15, 275	△ 5. 8	96. 7	2. 5
4月末	14, 139	△ 5. 1	15, 729	△ 3. 0	97. 0	2. 5
(期 末)2018年 5月 8日	14, 553	△ 2. 3	16, 237	0. 1	97. 1	2. 5

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円ベース) は、S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、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。S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円ベース) 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3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注4) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：14,893円 期末：14,553円 騰落率：△2.3%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市況は期を通じてはほぼ同水準となりましたが、配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因によるマイナスが大きく、

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」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、地域によってまちまちの値動きとなりました。

米国リート市況は、期首より、長期金利の低下による割安感が台頭したことで緩やかな上昇基調で始まりしました。2017年7月以降は、米国景気の底堅さやトランプ政権に対する政策期待などの好材料がある一方、利上げ懸念や北朝鮮をはじめとした地政学リスクもあって方向感のない動きとなりました。しかし2018年に入ると、好調な経済指標の発表により早期利上げ観測が高まったことから長期金利が上昇し、利回り資産としてのリートに売り圧力が強まり期末を迎えました。カナダリート市況は、期を通じては緩やかな上昇でした。

欧州リート市況は、2017年6月以降、ドイツなどで長期金利が上昇に転じたことやフランス大手リーートの増資発表が悪材料となり、上値が重い展開となりました。その後しばらくは、長期金利の影響を受ける一進一退の値動きとなりました。11月から12月にかけては、好調な不動産ファンダメンタルズや大手商業施設リートに対する買収観測などが好材料となり、フランスやドイツを中心として総じて堅調に推移しました。2018年に入ると、堅調な景気を受けた長期金利の上昇や米国株式の急落から売られる展開となりましたが、期末にかけては急落の反動で緩やかな上昇に転じました。

アジア・オセアニアリート市況は、香港およびシンガポールは、期首から自国金利が低下に転じたことや中国政府への政策期待などにより上昇しました。2017年8月以降は小動きの展開となりましたが、11月からは、一部リーートの好決算や世界的な景気見通しの改善などを反映し、上昇しました。2018年に入ると、他地域と同様に下落基調となりました。オーストラリアは、期首から商業施設セクターを中心に売られましたが、その後はアジア地域と似た値動きとなりました。

○為替相場

為替相場は、米ドルは、期首よりやや米ドル安で始まりましたが、2017年6月中旬からF R B (米国連邦準備制度理事会) の金融引き締めを受けて米ドル高となりました。7月中旬からは、トランプ政権の混乱や北朝鮮の地政学リスクを受けて円が買われたことからしばらく米ドル安が続きましたが、9月にはF O M C (米国連邦公開市場委員会) で2017年内の追加利上げの可能性が示唆されたことなどから、再び米ドル高に転じました。しかし2018年に入ると、米国政府高官のドル安容認発言や米国が保護主義的な政策を相次いで打ち出したことから、米ドル安が進みました。4月以降は、やや米ドル高に戻して期末を迎えました。

ユーロは、2017年6月下旬からE C B (欧州中央銀行) が金融引き締めを受けたことを受けて、ユーロ高が進みました。2018年2月以降は、リスク回避的な動きが強まって円が買われたことから、ユーロ安に転じました。英ポンドは期を通じてはわずかに英ポンド高となりました。

オーストラリア・ドルは、2017年6月以降、資源価格の上昇を受けて買われました。2018年2月中旬以降は、ユーロ同様リスク回避的な動きを受けてオーストラリア・ドル安に転じました。

◆前期における「今後の運用方針」

日本を除く先進国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、S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円ベース) を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。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

海外リート組入比率（不動産投信指数先物を含む。）は、期を通じて原則として98～99%台で運用を行ないました。

海外リートポートフォリオにつきましては、S & P先進国 R E I T 指数（除く日本）採用銘柄の中から流動性の高い海外リートを中心に通常50銘柄程度で組成し、結果として時価総額の大きい海外リートを主としたポートフォリオとなりました。また2017年6月中旬から、運用の効率化を図るため、先進国のリートを対象とした不動産投信指数先物を一部組み入れました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「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、海外リート組入比率（不動産投信指数先物取引を含む。）を基本的に98～99%台で推移させました。その結果、参考指数の下落に対しプラスのかい離が発生しました。

一方、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、組み入れている流動性の高い海外リートポートフォリオと参考指数との騰落率の差異、参考指数とファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

《今後の運用方針》

引き続き、日本を除く先進国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、S & P先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。なお、運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。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 (先物) (投資信託証券)	32円 (2) (30)
有価証券取引税 (投資信託証券)	30 (30)
その他費用 (保管費用) (その他)	22 (21) (0)
合 計	84

(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)投資信託証券

(2017年5月9日から2018年5月8日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 2,215.7 (4.85)	千アメリカ・ドル 98,192 (—)	千口 1,955.55 (—)	千アメリカ・ドル 88,632 (—)
	カナダ	千口 137.5 (—)	千カナダ・ドル 1,870 (—)	千口 123.3 (—)	千カナダ・ドル 1,696 (—)
	オーストラリア	千口 2,149.06 (—)	千オーストラリア・ドル 11,886 (—)	千口 1,971.87 (—)	千オーストラリア・ドル 10,901 (—)
	香港	千口 353 (—)	千香港ドル 23,428 (—)	千口 322 (—)	千香港ドル 21,376 (—)
	シンガポール	千口 2,758.4 (—)	千シンガポール・ドル 6,111 (△ 8)	千口 2,555.1 (—)	千シンガポール・ドル 5,544 (—)
	イギリス	千口 931.222 (△ 3.252)	千イギリス・ポンド 6,068 (△ 31)	千口 791.85 (—)	千イギリス・ポンド 5,109 (—)
	ユーロ (ベルギー)	千口 15.4 (—)	千ユーロ 1,668 (—)	千口 13.87 (—)	千ユーロ 1,497 (—)
	ユーロ (フランス)	千口 75.26 (—)	千ユーロ 5,526 (—)	千口 65.99 (—)	千ユーロ 4,841 (—)
	ユーロ (スペイン)	千口 48.49 (—)	千ユーロ 557 (—)	千口 70.38 (—)	千ユーロ 818 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千口 139.15 (—)	千ユーロ 7,751 (—)	千口 150.24 (—)	千ユーロ 7,156 (—)

(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。

(2)先物取引の種類別取引状況

(2017年5月9日から2018年5月8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
不動産投信指数 先物取引	1,022	921	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
投資信託証券

(2017年5月9日から2018年5月8日まで)

当 期				期			
買		付		売		付	
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	41.1	736,580	17,921	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	37.3	678,012	18,177
PROLOGIS INC (アメリカ)	77.6	540,317	6,962	PROLOGIS INC (アメリカ)	71.2	505,966	7,106
UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)	16.3	457,558	28,071	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	18.2	419,951	23,074
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	19.8	454,515	22,955	UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス)	14.73	410,471	27,866
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	20.9	422,542	20,217	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	19.3	388,986	20,154
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	54.9	400,539	7,295	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	50.3	367,236	7,300
WELLTOWER INC (アメリカ)	52.7	392,114	7,440	WELLTOWER INC (アメリカ)	47.3	351,964	7,441
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	29.7	382,387	12,874	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	27.4	351,317	12,821
BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)	27.1	373,213	13,771	BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)	24.3	335,840	13,820
VENTAS INC (アメリカ)	51.3	356,638	6,952	VENTAS INC (アメリカ)	46.8	326,696	6,980

(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)外国投資信託証券

銘 柄	期 首	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3.9	5.5	908	98,955
SIMON PROPERTY GROUP INC	7.3	11.1	1,773	193,146
BOSTON PROPERTIES INC	4.6	7.4	918	100,056
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	7.9	—	—	—
GGP INC	17	32.5	653	71,180
VORNADO REALTY TRUST	5.8	10.8	760	82,829
EQUITY RESIDENTIAL	9.9	14.5	906	98,699
HOST HOTELS & RESORTS INC	21.8	39.3	790	86,116
KIMCO REALTY CORP	14.8	25.2	368	40,152
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	—	17.1	442	48,142
GAMING AND LEISURE PROPTIE	—	19	658	71,680
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	14.9	—	—	—
VENTAS INC	9.2	13.7	730	79,601
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	26.2	385	42,031
IRON MOUNTAIN INC	—	14.1	485	52,887
VEREIT INC	34.6	68.5	478	52,147
PROLOGIS INC	14.1	20.5	1,342	146,216
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3.8	5.3	687	74,923
CAMDEN PROPERTY TRUST	4.1	—	—	—
COUSINS PROPERTIES INC	—	61.5	569	62,023
DUKE REALTY CORP	15.5	19.3	548	59,716
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2.1	3	724	78,944

銘 柄	期 首	当 期 末		
	口 数	口 数	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
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2.9	4.6	546	59,542
WELLTOWER INC	9	14.4	802	87,370
HCP INC	12	21.7	516	56,200
HIGHWOODS PROPERTIES INC	—	10.7	491	53,582
KILROY REALTY CORP	4.5	7.5	553	60,281
LIBERTY PROPERTY TRUST	9	12.9	558	60,777
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3.9	5.5	511	55,737
MACERICH CO/THE	4.1	—	—	—
REALTY INCOME CORP	8.1	12.8	674	73,424
PUBLIC STORAGE	3.6	5.2	1,091	118,918
REGENCY CENTERS CORP	5.5	9.1	535	58,374
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	8.2	—	—	—
SL GREEN REALTY CORP	3.4	6	602	65,581
UDR INC	11.1	14.8	539	58,704
WP CAREY INC	5.8	11.2	733	79,920
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	8.9	—	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	5.5	7.8	831	90,607
EXTRA SPACE STORAGE INC	4.2	6.1	569	62,076
DOUGLAS EMMETT INC	9.1	—	—	—
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	—	10.3	683	74,418
アメリカ・ドル	口 数、金 額	310.1	575.1	24,377
通 貨 計	銘柄数 < 比率 >	35銘柄	35銘柄	<69.6%>

銘柄	期首		当期末	
	□数	□数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	23.1	37.3	472	39,957
カナダ・ドル	□数、金額	23.1	37.3	472
通貨計	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄	<1.0%>
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
SCENTRE GROUP	180.76	249.3	1,022	83,722
STOCKLAND	128.08	183.76	769	63,066
WESTFIELD CORP	66.21	97.89	890	72,965
GOODMAN GROUP	75.31	96.6	883	72,399
オーストラリア・ドル	□数、金額	450.36	627.55	3,566
通貨計	銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄	<7.7%>
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT	71	102	6,783	94,080
香港ドル	□数、金額	71	102	6,783
通貨計	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄	<2.5%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
ASCENDANT REAL ESTATE INV TRT	—	269.4	713	58,255
CAPITALAND MALL TRUST	222.6	—	—	—
SUNTEC REIT	253.9	410.4	787	64,298
シンガポール・ドル	□数、金額	476.5	679.8	1,501
通貨計	銘柄数<比率>	2銘柄	2銘柄	<3.2%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	30.02	40.9	400	59,249
SEGRO PLC	—	76.44	489	72,315
HAMMERSON PLC	45.19	72.03	399	59,029
BRITISH LAND CO PLC	39.51	61.47	413	61,061
イギリス・ポンド	□数、金額	114.72	250.84	1,702
通貨計	銘柄数<比率>	3銘柄	4銘柄	<6.6%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円
COFINIMMO	2.66	4.19	465	60,497
国小計	□数、金額	2.66	4.19	465
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄	<1.6%>
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO SE	2.84	4.41	870	113,191
KLEPIERRE	8.53	16.23	549	71,355
国小計	□数、金額	11.37	20.64	1,420
	銘柄数<比率>	2銘柄	2銘柄	<4.8%>

銘柄	期首		当期末	
	□数	□数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
ユーロ (スペイン)	千口	千口	千ユーロ	千円
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	21.89	—	—	—
国小計	□数、金額	21.89	—	—
	銘柄数<比率>	1銘柄	—	<—>
ユーロ	□数、金額	35.92	24.83	1,885
通貨計	銘柄数<比率>	4銘柄	3銘柄	<6.4%>
合計	□数、金額	1,481.7	2,297.42	—
	銘柄数<比率>	50銘柄	50銘柄	<97.1%>

(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)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	DJ US REIT IDXFTRS (アメリカ)	百万円	百万円
		79	—
	STOXX600 REIT IDXFTF (ドイツ)	16	—

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年5月8日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
投資信託証券	千円	%
	3,700,418	97.0
コール・ローン等、その他	113,813	3.0
投資信託財産総額	3,814,231	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、5月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝108.91円、1カナダ・ドル＝84.55円、1オーストラリア・ドル＝81.91円、1香港ドル＝13.87円、1シンガポール・ドル＝81.60円、1イギリス・ポンド＝147.82円、1ユーロ＝129.96円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (3,745,282千円) の投資信託財産総額 (3,814,231千円) に対する比率は、98.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年5月8日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	3,865,015,223円
コール・ローン等	89,775,114
投資信託証券（評価額）	3,700,418,204
未収入金	54,135,816
未収配当金	5,219,052
差入委託証拠金	15,467,037
(B)負債	52,474,299
未払金	51,195,542
未払解約金	1,276,700
その他未払費用	2,057
(C)純資産総額（A－B）	3,812,540,924
元本	2,619,799,668
次期繰越損益金	1,192,741,256
(D)受益権総口数	2,619,799,668口
1万口当り基準価額（C／D）	14,553円

* 期首における元本額は1,712,907,275円、当期中における追加設定元本額は10,476,877,919円、同解約元本額は9,569,985,526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、先進国 R E I T（為替ヘッジなし）資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）19,706,282円、ダイナミック・アロケーション・ファンド（適格機関投資家専用）1,797,947,484円、先進国 R E I T ファンド（適格機関投資家専用）550,108,139円、リソナ ダイナミック・アロケーション・ファンド36,908,868円、堅実バランスファンド－ハジメの一步－34,129,642円、D Cダイワ 8 資産アロケーション・ファンド12,730円、D Cダイナミック・アロケーション・ファンド5,366,804円、ダイワ外国 3 資産アロケーション・ファンド（部分為替ヘッジあり）175,619,719円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,553円です。

■損益の状況

当期 自2017年5月9日 至2018年5月8日

項 目	当 期
(A)配当等収益	139,442,688円
受取配当金	139,483,196
受取利息	32,837
その他収益金	33,487
支払利息	△ 106,832
(B)有価証券売買損益	△ 162,221,867
売買益	376,491,291
売買損	△ 538,713,158
(C)先物取引等損益	△ 3,251,108
取引益	10,087,453
取引損	△ 13,338,561
(D)その他費用	△ 5,758,509
(E)当期損益金（A＋B＋C＋D）	△ 31,788,796
(F)前期繰越損益金	838,074,345
(G)解約差損益金	△ 4,920,987,874
(H)追加信託差損益金	5,307,443,581
(I)合計（E＋F＋G＋H）	1,192,741,256
次期繰越損益金（I）	1,192,741,256

（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。

ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)

運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2018年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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

<5699>

★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。	
主要投資対象	ベビーファンド	イ. 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 ロ. 先進国REIT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。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）
	先進国REITマザーファンド	イ. 先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ. 先進国のリート指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券） ハ. 先進国のリートを対象としたリート指数先物取引 ニ. 国内の債券
ベビーファンドの運用方法	①主として、マザーファンドの受益証券を通じて、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。 ②マザーファンドの受益証券の組入比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。 ④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。	
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
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	
	先進国REIT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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

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

設定以来の運用実績

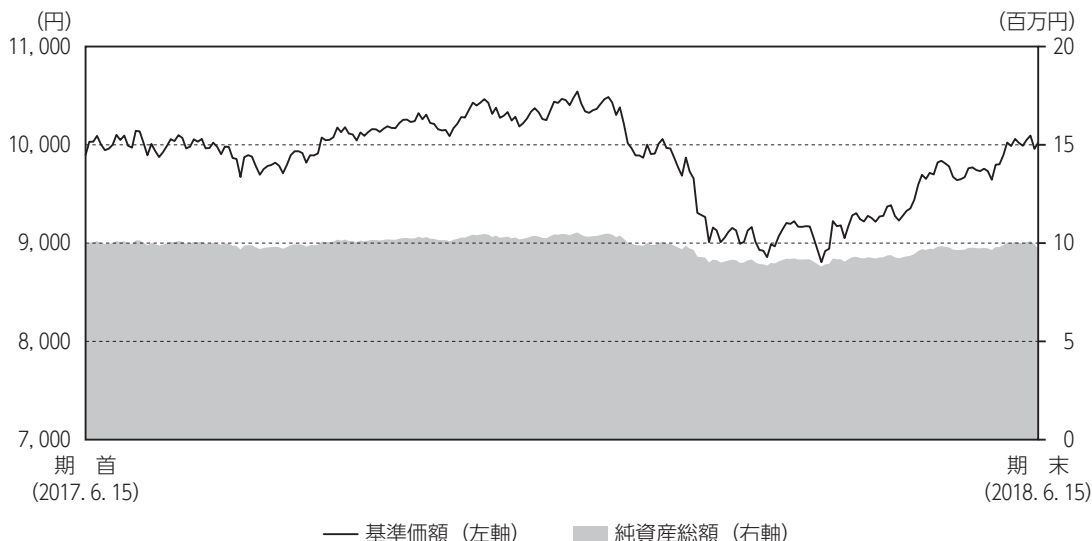
決 算 期	基 準 価 額			S & P先進国 REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 数 先 物 比 率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(参考指数)	期 中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6 月15日)	9,897	100	△ 0.0	9,936	△ 0.6	—	100.1	—	9
2 期末 (2018年 6 月15日)	9,694	330	1.3	10,224	2.9	0.8	101.1	1.0	9

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) 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 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) 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) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 期末の基準価額は分配金込みです。

■基準価額・騰落率

期首：9,897円

期末：9,694円（分配金330円）

騰落率：1.3%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、主要通貨が円に対して上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 先 物 比 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
(期首)2017年 6 月15日	円	%		%	%	%	%
	9,897	—	9,936	—	—	100.1	—
6 月末	9,990	0.9	10,150	2.2	—	99.1	—
7 月末	9,965	0.7	10,145	2.1	0.3	99.1	—
8 月末	9,894	△ 0.0	10,005	0.7	0.2	99.0	—
9 月末	10,130	2.4	10,265	3.3	0.6	98.2	—
10月末	10,089	1.9	10,238	3.0	0.4	98.7	0.6
11月末	10,268	3.7	10,410	4.8	0.3	98.9	0.5
12月末	10,487	6.0	10,648	7.2	1.0	97.0	1.2
2018年 1 月末	9,686	△ 2.1	9,857	△ 0.8	1.0	97.7	1.2
2 月末	9,014	△ 8.9	9,194	△ 7.5	0.6	98.1	1.1
3 月末	9,172	△ 7.3	9,352	△ 5.9	0.8	97.7	1.0
4 月末	9,442	△ 4.6	9,629	△ 3.1	0.8	97.8	1.0
5 月末	9,798	△ 1.0	10,014	0.8	0.7	97.7	1.0
(期末)2018年 6 月15日	10,024	1.3	10,224	2.9	0.8	101.1	1.0

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■海外リート市況

米国リート市況は、期首より、米国景気の底堅さやトランプ政権に対する政策期待などの好材料がある一方、利上げ懸念や北朝鮮をはじめとした地政学リスクもあって、方向感のない動きとなりました。しかし2018年に入ると、好調な経済指標の発表により早期利上げ観測が高まったことから長期金利が上昇し、利回り資産としてのリートに売り圧力が強まりました。期末にかけては、主要リートの好調な決算発表を受けやや値を戻しました。カナダリート市況は、期を通じて緩やかな上昇となりました。

欧州リート市況は、期首より、ドイツなどで長期金利が上昇に転じたことや、フランス大手リートの増資発表が悪材料となり、上値が重い展開となりました。その後は、長期金利の影響を受ける一進一退の値動きとなりました。2017年11月から12月にかけては、好調な不動産ファンダメンタルズや大手商業施設リートに対する買収観測などが好材料となり、フランスやドイツを中心として総じて堅調に推移しました。2018年に入ると、堅調な景気を受けた長期金利の上昇や米国株式の急落から売られる展開となりましたが、期末にかけては急落の反動で緩やかな上昇に転じました。

アジア・オセアニアリート市況は、香港およびシンガポールは、期首から、自国金利が低下に転じたことや中国政府への政策期待などにより、上昇しました。2017年8月以降は、アジアでは小動きの展開となりましたが、11月からは、一部リートの好決算や世界的な景気見通しの改善などを反映し、上昇しました。2018年に入ると、他地域と同様に下落基調となりましたが、期末にかけて香港は再び上昇しました。オーストラリアは、期首から商業施設セクターを中心に売られましたが、その後はアジア地域と似た値動きとなりました。

■為替相場

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

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

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（Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。リートの組入比率は、期を通じて原則として98%以上で運用を行ないます。

■先進国ＲＥＩＴマザーファンド

海外先進国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、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に、日本を除く先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。

ポートフォリオについて

（2017. 6. 16 ～ 2018. 6. 15）

■当ファンド

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行ないました。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

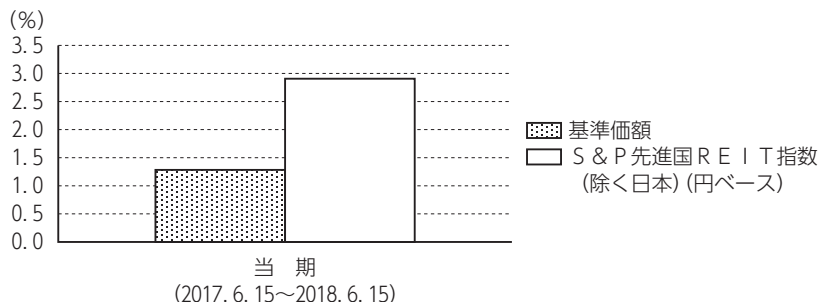
ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエートで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行ないました。

また、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ＥＴＦ）および不動産投信指数先物を組み入れました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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。



分配金について

当期の 1 万口当り分配金（税込み）は 330 円といたしました。

収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1 万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1 万口当り）

項 目	当 期	
	2017 年 6 月 16 日 ～2018 年 6 月 15 日	
当期分配金（税込み）（円）		330
対基準価額比率（％）		3. 29
当期の収益（円）		330
当期の収益以外（円）		—
翌期繰越分配対象額（円）		39

（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。

収益分配金の計算過程（1 万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	350. 41円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0. 00
(c) 収益調整金	0. 00
(d) 分配準備積立金	19. 57
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	369. 99
(f) 分配金	330. 00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	39. 99

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託（ＥＴＦ）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

■先進国ＲＥＩＴマザーファンド

日本を除く先進国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、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。なお、運用の効率化を図るため、外国投資信託ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 6. 16～2018. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	42円	0. 426%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9, 843円です。
(投 信 会 社)	(29)	(0. 297)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(11)	(0. 108)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0. 022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	2	0. 019	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先 物)	(0)	(0. 002)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0. 000)	
(投資信託証券)	(2)	(0. 017)	
有価証券取引税	3	0. 027	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託受益証券)	(0)	(0. 000)	
(投資信託証券)	(3)	(0. 027)	
そ の 他 費 用	12	0. 123	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(11)	(0. 111)	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. 008)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	59	0. 595	

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

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年6月16日から2018年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド	—	—	65	142

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当期中における利害関係人との取引はありません。

■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

期首保有額	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	当初設定時における取得
10	—	—	10	

(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	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド	4,618	4,552	10,022

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド	10,022	99.8
コール・ローン等、その他	21	0.2
投資信託財産総額	10,044	100.0

(注 1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注 2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝110.68円、1カナダ・ドル＝84.33円、1オーストラリア・ドル＝82.53円、1香港ドル＝14.10円、1シンガポール・ドル＝82.20円、1ニュージーランド・ドル＝76.93円、1イギリス・ポンド＝146.66円、1イスラエル・シェケル＝30.62円、1ユーロ＝127.90円です。
 (注 3) ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (16,700.675千円) の投資信託財産総額 (16,888,374千円) に対する比率は、98.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	10,044,305円
コール・ローン等	21,513
ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド (評価額)	10,022,792
(B) 負債	350,514
未払収益分配金	330,000
未払信託報酬	20,332
その他未払費用	182
(C) 純資産総額 (A－B)	9,693,791
元本	10,000,000
次期繰越損益金	△ 306,209
(D) 受益権総口数	10,000,000口
1万口当り基準価額 (C／D)	9,694円

* 期首における元本額は10,000,000円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は0円です。
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は9,694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306,209円です。

■損益の状況

当期 自 2017年 6月16日 至 2018年 6月15日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	169, 225円
売利益	170, 027
売買損	△ 802
(B) 信託報酬等	△ 42, 188
(C) 当期損益金 (A + B)	127, 037
(D) 前期繰越損益金	△ 103, 246
(E) 合計 (C + D)	23, 791
(F) 収益分配金	△ 330, 000
次期繰越損益金 (E + F)	△ 306, 209
分配準備積立金	39, 991
繰越損益金	△ 346, 200

(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) 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	350, 417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	19, 574
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	369, 991
(f) 分配金	330, 000
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	39, 991
(h) 受益権総口数	10, 000, 000口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	330円

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

《お知らせ》

■マザーファンドにおける先物取引の利用について

当ファンドの主要投資対象である「ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド」において、不動産投信指数先物取引を利用できるように約款を変更しました。

★「ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド」の第13期にかかる運用状況については329～337ページ、「先進国 R E I T マザーファンド」の第 5 期にかかる運用状況については338～343ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワ S M A 専用））が投資対象としている「ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド」の決算日（2017年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なりますので、当ファンドの決算日（2018年 6 月15日）現在におけるダイワ・グローバル R E I T 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。320～328ページをご参照ください。