

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投資／内外／資産複合／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	国内外の株式および債券に投資し、信託財産の中長期的な成長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	①トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券 ②ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)の受益証券 ③外国株式インデックスマザーファンドの受益証券 ④外国債券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。)
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	内外の公社債等(各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。)
	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。)
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債
ベビーファンドの運用方法	<p>①主として、各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。</p> <p>②各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行ないます。ただし、市況動向等によっては、内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。また、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。</p> <p>トピックス・インデックス・マザーファンド受益証券 …信託財産の純資産総額の30%</p> <p>ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)受益証券 …信託財産の純資産総額の40%</p> <p>外国株式インデックスマザーファンド受益証券 …信託財産の純資産総額の20%</p> <p>外国債券インデックスマザーファンド受益証券 …信託財産の純資産総額の10%</p> <p>③保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利息等の受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。</p> <p>④保有実質外貨建資産とは、信託財産にかかる保有外貨建資産および各マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした資産との合計をいいます。</p> <p>⑤株式以外の資産への投資は、原則として、信託財産総額の75%以下とします。</p>	
組入制限	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の70%未満
	トピックス・インデックス・マザーファンドの株式組入上限比率	無制限
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)の株式組入上限比率	純資産総額の10%以下
	外国株式インデックスマザーファンドの株式組入上限比率	無制限
分配方針	外国債券インデックスマザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の30%以下
	分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、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・ライフ・バランス50

運用報告書(全体版) 第12期 (決算日 2017年6月5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・ライフ・バランス50」は、このたび、第12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/>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成ベンチマーク		株式組入率 比	株式先物率 比	公社債 組入比率	投資証券 組入比率	純資産額
	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク) 期中 騰落率							
8 期末(2013年6月5日)	円 12,662	円 0	% 32.2	12,029	% 30.8	% 47.9	% 0.9	% 49.8	% 0.4	百万円 3,768
9 期末(2014年6月5日)	14,020	0	10.7	13,262	10.3	49.4	0.7	48.6	0.4	4,783
10期末(2015年6月5日)	16,552	0	18.1	15,563	17.4	49.4	0.6	48.7	0.4	6,170
11期末(2016年6月6日)	15,313	0	△ 7.5	14,347	△ 7.8	48.0	0.7	49.7	0.5	6,343
12期末(2017年6月5日)	16,888	0	10.3	15,715	9.5	49.1	0.6	49.0	0.5	7,577

(注1) 合成ベンチマークは、下記の指数と配分比率をもとに、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。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。

投資対象資産	指数	配分比率
国内株式	TOPIX	30%
国内債券	NOMURA-BPI総合指数	40%
外国株式	MSCIコクサイ指数(円ベース)	20%
外国債券	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)	10%

(注2) 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。

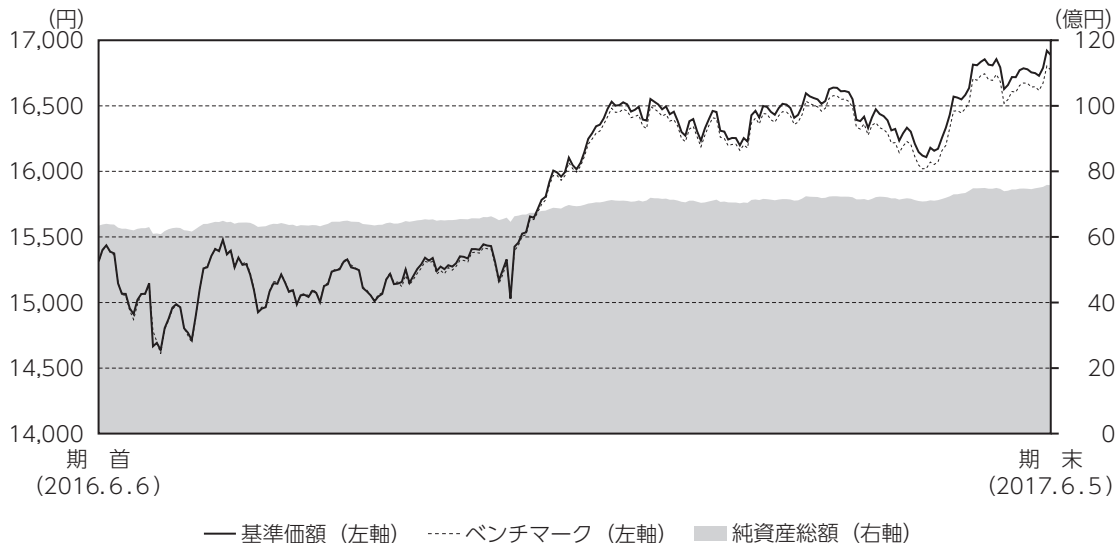
(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

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



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。

* ベンチマークは合成ベンチマークです。

■ 基準価額・騰落率

期首：15,313円
 期末：16,888円
 騰落率：10.3%

■ 組入ファンドの当期中の騰落率

組入ファンド	騰落率
トピックス・インデックス・マザーファンド	23.4%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)	△2.2%
外国株式インデックスマザーファンド	22.2%
外国債券インデックスマザーファンド	2.3%

■ 基準価額の主な変動要因

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券に投資した結果、国内株式、外国株式、外国債券の上昇が寄与し、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・ライフ・バランス50

年 月 日	基 準 価 額		合 成 ベ ン チ マ ー ク		株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 株 比	公 社 債 率 公 組 入 比	投 信 託 証 比 組 入 証 比	資 券 率 証 比
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率					
(期首) 2016年 6 月 6 日	円 15,313	% -	14,347	% -	% 48.0	% 0.7	% 49.7	% 0.5	
6 月 末	14,875	△ 2.9	13,925	△2.9	47.0	0.8	50.5	0.5	
7 月 末	15,293	△ 0.1	14,344	△0.0	48.7	0.5	49.2	0.6	
8 月 末	15,236	△ 0.5	14,278	△0.5	49.3	0.6	48.6	0.5	
9 月 末	15,150	△ 1.1	14,180	△1.2	48.7	0.7	49.1	0.5	
10 月 末	15,434	0.8	14,438	0.6	49.4	0.7	48.2	0.5	
11 月 末	15,995	4.5	14,961	4.3	50.4	0.6	46.8	0.5	
12 月 末	16,387	7.0	15,297	6.6	50.7	0.4	47.1	0.5	
2017年 1 月 末	16,310	6.5	15,235	6.2	49.9	0.4	48.2	0.5	
2 月 末	16,431	7.3	15,343	6.9	49.8	0.5	48.3	0.5	
3 月 末	16,421	7.2	15,289	6.6	48.5	1.0	49.2	0.5	
4 月 末	16,549	8.1	15,408	7.4	48.9	0.7	49.0	0.5	
5 月 末	16,729	9.2	15,569	8.5	48.5	0.7	48.9	0.5	
(期末) 2017年 6 月 5 日	16,888	10.3	15,715	9.5	49.1	0.6	49.0	0.5	

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2016.6.7～2017.6.5)

国内株式市況

国内株式市況は、期首より、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱支持派が多数だったことを受けて下落しましたが、2016年7月に入ると、国内の財政・金融政策への期待や円高傾向の一服などで上昇しました。8月からは、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、株価は一進一退で推移しました。11月は、米国大統領選挙でのトランプ氏勝利を受けて一時的に投資家のリスク回避姿勢が強まり株価は下落しましたが、その後はトランプ氏の景気刺激政策への期待から、上昇基調で推移しました。12月半ば以降は、株価の急上昇に対する警戒感に加えてトランプ氏の政策に対する期待と不透明感が交錯し、株価は一進一退で推移しました。2017年4月に入ると、東アジアの地政学リスクの高まりが懸念され、株価は下落しました。しかし4月後半からは、地政学リスク悪化の一巡に加えて、フランス大統領選挙で中道派のマクロン氏が極右政党の候補者を抑えて当選したことが好感され、株価は上昇しました。

国内債券市況

国内長期金利は、期首より、日銀の追加金融緩和への期待などから2016年7月下旬にかけて低下しました。7月末には、日銀は次回会合で経済・物価動向や政策効果について総括的な検証を行なうことを発表しましたが、総括的な検証が日銀の金融緩和姿勢の後退につながる恐れがあるとの警戒感が高まったことから、国内長期金利は8月上旬にかけて急上昇した後、横ばい程度で推移しました。その後11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利すると、今後の財政支出拡大などが意識されて米国の金利が上昇し、国内長期金利も上昇しました。12月には、FOMC（米国連邦公開市場委員会）で政策金利が引き上げられたほか、政策金利の見通しが上方修正されて米国の金利がさらに上昇し、国内長期金利も上昇傾向となりました。その後2017年3月にかけては、国内長期金利はおおむね横ばい圏で推移し、4月以降は、弱めの経済指標や地政学リスクの強まりなどを背景に欧米の長期金利が低下したことに連れ、国内長期金利は小幅に低下した後、期末にかけておおむね横ばい圏で推移しました。

外国株式市況

米国・欧州を中心とする外国株式市況は、2016年6月下旬に英国の国民投票で予想に反してEU離脱派が多数となると欧州情勢への懸念が高まり、一時的に急落しましたが、その後は英国および各国の中央銀行が政策協調を表明したことが好感され、落ち着きを取り戻し反発しました。11月に入ると、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことによる新政権の政策への期待から、市況は米国市場を中心に上昇に転じました。2017年1月以降は、トランプ大統領が石油パイプラインの建設を前進させる大統領令に署名したことや大型減税を示唆したことにより景気拡大への期待が高まったことなどを背景に、市況の上昇基調は継続しました。4月以降は、朝鮮半島の緊迫化など地政学リスクへの警戒感を背景に神経質な展開となりましたが、フランス大統領選挙の結果が世論調査通りとなったことなどを受けて上昇し、期を通じては上昇して期末を迎えました。

■外国債券市況

主要国の国債金利は、2016年6月に英国のEU離脱を問う国民投票で離脱派が勝利し、市場のリスク回避姿勢が強まったことから、低下しました。8月以降は、ECB（欧州中央銀行）の資産買い入れの減額観測が出たことなどから金利は上昇しました。また、11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利し、今後の財政拡大などが意識されたこともさらなる金利上昇の要因となりました。12月に米国で利上げが行なわれたことで、米国の金利は上昇した一方、欧州では金融緩和が継続されたため金利は低下しました。その後、金利は上下に振れながらもおおむねレンジ内での推移となりました。2017年3月中旬以降は、トランプ政権の政策に対する不透明感などから金利は低下し、その後はおおむねレンジ内での推移となりました。

■為替相場

為替相場は、期首より、米国の早期利上げ観測の後退や英国の国民投票の結果を受けたリスク回避姿勢の動きから、円高傾向での推移となりました。2016年7月に入るといったんは円安となりましたが、日銀の金融政策決定会合で政策金利が据え置かれたことが市場の失望を誘い、再び円高が進行しました。その後は横ばい程度の推移でしたが、11月に米国でトランプ氏が勝利したことや12月の米国の利上げにより金利が上昇し、円安となりました。2017年に入ると、トランプ政権に対する期待感の後退や欧州の政治情勢の不透明感などから円高傾向となりました。4月には欧州の政治リスクが後退したことから円安に転じましたが、5月はトランプ大統領のロシアとの不透明な関係をめぐる疑惑への懸念が高まったことで、主に米ドルが下落しました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

4本のマザーファンドの受益証券を、あらかじめ定められた標準組入比率をめぐりに組み入れることにより、信託財産の中長期的な成長をめざした運用を行なってまいります。

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

わが国の公社債等に投資し、ベンチマーク（NOMURA-BPI総合指数）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

■外国株式インデックスマザーファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2016.6.7～2017.6.5)

■当ファンド

4種類（トピックス・日本債券・外国株式・外国債券）の各インデックスマザーファンドの受益証券を規定の標準組入比率（トピックス：30%、日本債券：40%、外国株式：20%、外国債券：10%）に応じて組み入れ、各マザーファンドの受益証券の合計組入比率がおおむね100%程度となるように運用いたしました。

■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（株価変動を数率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）を用いて構築しました。

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

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

公社債組入比率を99%前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに近づけることにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざしました。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。

■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。

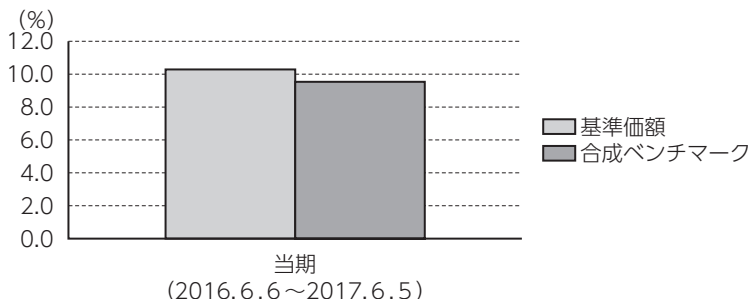
■外国債券インデックスマザーファンド

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

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマーク（合成ベンチマーク）との騰落率の対比です。

- ・株式の配当について、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、ファンドで組み入れている各マザーファンドの騰落率とそれに対応する各ベンチマークの騰落率との差異、各マザーファンドの組入比率とファンドの標準組入比率とのズレ、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。



分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2016年6月7日 ～2017年6月5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)	—
翌期繰越分配可能額	(円)	9,664

(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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等です。



今後の運用方針

■当ファンド

4本のマザーファンドの受益証券をあらかじめ定められた標準組入比率をめぐりに組み入れることにより、信託財産の中長期的な成長をめざした運用を行なってまいります。

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

今後もわが国の公社債等に投資し、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います。

■外国株式インデックスマザーファンド

今後の運用にあたりまして、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。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2016.6.7~2017.6.5)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	34円	0.215%	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15,860円です。
(投 信 会 社)	(14)	(0.086)	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)	(15)	(0.097)	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)	(5)	(0.032)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.001)	
(先 物)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	4	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)	(2)	(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)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	38	0.240	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2016年6月7日から2017年6月5日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	174,841	143,731	202,250	178,711
外国株式インデックスマザーファンド	59,136	105,891	64,541	132,973
外国債券インデックスマザーファンド	41,199	106,829	1,874	4,922
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	427,747	543,795	43,608	56,439

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2016年6月7日から2017年6月5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	17,753,420千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	120,609,865千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.14
	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	8,714,579千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	75,248,976千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) トピックス・インデックス・マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2016年6月7日から2017年6月5日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
株式	6,258	1,636	26.1	11,495	40	0.3
株式先物取引	15,712	-	-	16,430	-	-
コール・ローン	1,255,801	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合1.7%

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

(3) 外国株式インデックスマザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(4) 外国債券インデックスマザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2016年6月7日から2017年6月5日まで)

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	5,645	452	8.0	4,328	205	4.7
コール・ローン	22,502	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合17.9%

(6) 利害関係人の発行する有価証券等

(2016年6月7日から2017年6月5日まで)

種 類	当 期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株式	百万円 10	百万円 26	百万円 343

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(7) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2016年6月7日から2017年6月5日まで)

種 類	当 期	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	
	買 付 額	
株式	百万円 4	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(8) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■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	口 数	評 価 額
	千口	千口	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	2,352,182	2,324,772	2,302,687	
外国株式インデックスマザーファンド	692,365	686,960	1,504,580	
外国債券インデックスマザーファンド	238,646	277,971	747,187	
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,979,177	2,363,317	2,993,141	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年6月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	2,302,687	30.3
外国株式インデックスマザーファンド	1,504,580	19.8
外国債券インデックスマザーファンド	747,187	9.8
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	2,993,141	39.4
コール・ローン等、その他	41,705	0.7
投資信託財産総額	7,589,302	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5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.49円、1カナダ・ドル=81.85円、1オーストラリア・ドル=82.04円、1香港ドル=14.18円、1シンガポール・ドル=79.97円、1ニュージーランド・ドル=78.91円、1イギリス・ポンド=142.16円、1イスラエル・シケル=31.15円、1スイス・フラン=114.62円、1デンマーク・クローネ=16.74円、1ノルウェー・クローネ=13.12円、1スウェーデン・クローネ=12.80円、1メキシコ・ペソ=5.90円、1マレーシア・リンギット=25.89円、1南アフリカ・ランド=8.60円、1ポーランド・ズロチ=29.76円、1ユーロ=124.54円です。

(注3) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(86,987,679千円)の投資信託財産総額(87,587,078千円)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において、当期末における外貨建純資産(159,784,341千円)の投資信託財産総額(163,371,362千円)に対する比率は、97.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年6月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	7,589,302,131円
コール・ローン等	41,705,005
トピックス・インデックス・マザーファンド(評価額)	2,302,687,484
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	1,504,580,685
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	747,187,375
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)(評価額)	2,993,141,582
(B) 負債	11,933,320
未払解約金	3,928,808
未払信託報酬	7,715,258
その他未払費用	289,254
(C) 純資産総額(A-B)	7,577,368,811
元本	4,486,718,406
次期繰越損益金	3,090,650,405
(D) 受益権総口数	4,486,718,406口
1万口当り基準価額(C/D)	16,888円

*期首における元本額は4,142,420,135円、当期中における追加設定元本額は742,279,216円、同解約元本額は397,980,945円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は16,888円です。

■損益の状況

当期 自2016年6月7日 至2017年6月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 16,321円
受取利息	707
支払利息	△ 17,028
(B) 有価証券売買損益	676,657,821
売買益	761,586,642
売買損	△ 84,928,821
(C) 信託報酬等	△ 15,262,486
(D) 当期損益金(A+B+C)	661,379,014
(E) 前期繰越損益金	1,130,177,957
(F) 追加信託差損益金	1,299,093,434
(配当等相当額)	(2,544,702,107)
(売買損益相当額)	(△1,245,608,673)
(G) 合計(D+E+F)	3,090,650,405
次期繰越損益金(G)	3,090,650,405
追加信託差損益金	1,299,093,434
(配当等相当額)	(2,544,702,107)
(売買損益相当額)	(△1,245,608,673)
分配準備積立金	1,791,573,292
繰越損益金	△ 16,321

(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12ページの「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	241,976,744
(c) 収益調整金	2,544,702,107
(d) 分配準備積立金	1,549,596,548
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	4,336,275,399
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	4,336,275,399
(h) 受益権総口数	4,486,718,406口

<補足情報>

当ファンド（ダイワ・ライフ・バランス50）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2016年9月20日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017年6月5日）現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を13～19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 株式

(2016年6月7日から2017年6月5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	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		千株	千円	円		千株	千円	円
九州旅客鉄道	58.2	182,226	3,131	ソフトバンクグループ	79.4	541,654	6,821	トヨタ自動車	67.98	444,590	6,540	東芝	1,327	321,329	242
日本電信電話	33.3	157,375	4,725	三菱UFJフィナンシャルG	459.6	284,813	619	日本たばこ産業	40.1	159,035	3,965	日産自動車	148.3	157,902	1,064
東日本旅客鉄道	10.3	97,149	9,431	日本電信電話	46	140,544	3,055	みずほフィナンシャルG	681	131,880	193	デンソー	17.5	77,161	4,409
トヨタ自動車	15.6	84,781	5,434	アステラス製薬	78.4	124,786	1,591	本田技研	20.7	61,236	2,958	野村ホールディングス	111.1	60,847	547
日本電産	8.5	82,690	9,728					キヤノン	18.4	57,776	3,140				
ペプチドリーム	11.3	77,349	6,845												
デンソー	17.5	77,161	4,409												
本田技研	20.7	61,236	2,958												
野村ホールディングス	111.1	60,847	547												
キヤノン	18.4	57,776	3,140												

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

組入資産明細表

下記は、2017年6月5日現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンド（134,619,084千円）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5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%)			長谷工コーポレーション	73.9	107,820	五洋建設	69.6	44,404	大気社	7.2	22,212
極洋	3.2	9,808	松井建設	8.2	7,330	大林道路	8	7,512	ダイダグ	9	10,818
日本水産	85.2	50,097	鹿島建設	277	240,436	世紀東急	16.8	9,811	日比谷総合設備	4.4	7,968
マルハニチロ	12	38,220	不動産トラ	56.6	10,584	福田組	10	10,490	東芝プラントシステム	10.5	17,524
カネコ種苗	3.1	4,569	鉄建建設	41	14,350	住友林業	42.8	79,051	OSJB HD	27.2	7,942
サカタのタネ	9.2	32,752	西松建設	73	44,530	日本基礎技術	11.9	4,379	東洋エンジニア	37	9,546
ホクト	6.6	13,510	三井住友建設	243.9	30,487	日成ビルド工業	21	14,049	千代田化工建	46	29,624
鉱業 (0.3%)			大豊建設	24	13,344	パナホーム	24	29,256	新興プランテック	14	11,704
日鉄鉱業	1.8	10,566	前田建設	41	49,856	大和ハウス	185.3	686,165	食料品 (4.8%)		
三井松島	6.7	9,112	奥村組	47	35,344	ライト工業	12.3	15,301	日本製粉	17.1	31,019
国際石油開発帝石	333.9	343,249	東鉄工業	7.7	27,181	積水ハウス	193.3	377,708	日清製粉G本社	67.7	128,426
日本海洋掘削	2.4	5,479	浅沼組	23	7,452	ユアテック	8	6,152	昭和産業	24	14,808
石油資源開発	9.5	21,052	戸田建設	74	52,984	西部電気工業	3.2	7,305	中部飼料	8.5	11,951
K&Oエナジーグループ	4	7,228	熊谷組	101	34,845	中電工	5.4	15,525	フィード・ワン	47	10,669
建設業 (3.1%)			北野建設	18	5,796	開電工	2.5	28,475	日本甜菜糖	2.4	5,520
ショーボンドHD	6.3	34,713	三井ホーム	12	8,916	きんでん	41.2	71,523	三井製糖	4.5	14,850
ミライト・ホールディングス	19.2	22,272	矢作建設	9.7	8,807	東京エネクス	6.7	6,559	塩水港精糖	22.6	5,446
タマホーム	13.3	8,618	ピーエス三菱	16	8,048	トーエネック	8	5,488	日新製糖	0.8	1,499
安藤・間	45.6	36,662	日本ハウスHLDGS	17.4	9,500	住友電設	4.8	7,401	森永製菓	12.5	85,375
東急建設	22.7	22,473	大東建託	23.1	408,985	日本電設工業	10	23,390	中村屋	2.1	10,626
コムシスホールディングス	24.3	57,882	新日本建設	7.9	8,097	協和エクシオ	24.3	45,149	江崎グリコ	15.8	102,384
ミサワホーム	11.1	11,044	NIPPO	13	29,653	九電工	12.4	49,166	不二家	39	10,296
高松コンストラクショングP	4.6	13,234	東亜道路	21	9,954	三機工業	13.4	16,187	山崎製パン	46.1	110,409
東建コーポレーション	2.4	24,672	前田道路	18	41,112	日揮	59.1	102,834	モロゾフ	19	12,008
大成建設	321	312,975	日本道路	18	10,386	中外炉工業	29	6,293	亀田製菓	3.7	21,349
大林組	188.6	235,561	東亜建設	6.7	14,311	太平電業	9	11,880	寿スピリッツ	6	23,580
清水建設	193	220,020	若築建設	57	9,633	高砂熱学	16.6	30,461	カルビー	25.7	115,136
飛島建設	70.3	12,302	東洋建設	20.7	8,756	明星工業	13.4	8,830	森永乳業	60	56,640

銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
六甲バター	千株	千円	オンワードホールディングス	千株	千円	タキロンシーアイ	千株	千円	ジェイ エス ピー	千株	千円
ヤクルト	3.2	8,848	ゴールドウイン	37	30,192	旭有機材	15	8,610	エフピコ	2.7	7,433
明治ホールディングス	34.1	276,551	デサント	2.6	17,368	日立化成	33	8,052	天馬	5.4	32,616
雪印メグミルク	37.5	352,875	パルプ・紙 (0.3%)	12.6	17,690	ニチバン	32.1	100,954	信越ポリマー	1.8	3,751
プリマハム	13.7	46,648	特殊東海製紙	3	12,615	リケンテクノス	7	6,902	東リ	12.7	10,464
日本ハム	41	24,445	王子ホールディングス	216	121,392	大倉工業	13.5	7,546	ニフコ	21.3	7,668
丸大食品	44	154,220	日本製紙	25.5	54,570	積水化成	22	13,464	日本バルカー	10.2	59,568
S Foods	30	15,780	三菱製紙	25.5	54,570	群栄化学	7.4	6,364	ユニ・チャーム	5.7	12,602
伊藤ハム米スHLDGS	3.6	13,986	北越紀州製紙	11.4	8,732	タイガース ポリマー	1.8	6,597	協和発酵キリン	119.6	367,530
サッポロホールディングス	36.8	38,345	中越パルプ	31.9	27,880	ダイキョーニシカワ	5.9	4,501	武田薬品	70.3	137,717
アサヒグループホールディングス	21.1	69,419	巴川製紙	27	6,561	日本化薬	10.5	16,033	アステラス製薬	221	1,283,126
キリンHD	119.1	535,950	レンゴー	30	7,440	日本精工	38	59,926	大日本住友製薬	600.5	849,407
宝ホールディングス	272.7	666,751	トーモク	24.1	33,812	扶桑化学工業	7.6	7,630	塩野義製薬	41.9	73,325
オエノンホールディングス	45.2	54,240	ザ・パック	24	9,168	ADEKA	4.4	16,874	田辺三菱製薬	74.4	444,019
オエノンホールディングス	31	8,494	化学 (7.0%)	3.9	13,962	日油	23.5	39,550	あすか製薬	68.3	174,711
コカ・コーラボトラーズJ	39.6	144,540	クラレ	97.5	198,705	花王	45	65,655	日本新薬	7	12,278
サントリー食品インター	43.2	238,032	旭化成	367	401,314	第一工業製薬	147.9	1,059,407	中外製薬	13.5	91,530
グイドーグループHD	2.7	15,849	共和レザー	4.3	4,003	三洋化成	19	8,949	科研製薬	58.9	257,098
伊藤園	18.7	83,402	昭和電工	43.4	102,510	大日本塗料	3.4	17,748	エーザイ	10.9	68,888
キーコーヒー	6.2	13,776	住友化学	43.4	102,510	日本ペイントHOLD	37	10,212	ロート製薬	71.8	438,913
日清オイログループ	35	23,695	住友精工	432	260,496	関西ペイント	45.1	199,342	小野薬品	28.9	69,735
不二製油グループ	16.8	46,116	日産化学	2.6	13,338	中国塗料	61.7	149,622	久光製薬	135.8	318,383
J-オイルミルズ	2.4	9,924	日産化学	32.1	124,387	日本特殊塗料	16.3	13,382	持田製薬	16.6	96,612
キッコーマン	43.2	156,384	ラサ工業	82	11,644	藤倉化成	4.3	7,146	参天製薬	4	32,240
味の素	130.4	314,524	フレハ	4.3	24,725	太陽ホールディングス	11.1	7,048	扶桑製薬	106.2	170,769
キユーピー	32.5	96,330	テイカ	11	11,550	DIC	4.7	23,500	日本ケミファ	2.7	7,638
ハウス食品G本社	22.9	66,295	石原産業	12.6	13,708	サカタインクス	23	91,885	ツムラ	1.2	6,360
カゴメ	23	83,605	日東エフシー	1.7	1,518	東洋インクSCホールディン	11.7	20,404	日医工	19.6	81,830
アリアケジャパン	5.2	42,640	日本曹達	35	20,440	T & K TOKA	53	30,263	ティーエスエス薬品工業	14.5	23,939
ニチレイ	31.2	99,372	東ソノ	369	172,887	富士フイルムHLDGS	6.3	7,434	生化学工業	10.2	30,049
東洋水産	30.7	136,001	トクヤマ	99	51,084	資生堂	116	476,760	栄研化学	10.8	19,893
日清食品HD	24.6	178,842	セントラル硝子	59	27,317	ライオン	112.1	442,570	水製薬	5	16,500
永谷園ホールディングス	8	11,368	東亜合成	35	46,515	高砂香料	73.7	181,302	鳥居薬品	3.8	5,335
フジッコ	6.4	17,267	大阪ソーダ	26	13,494	メック	4.1	17,158	JCRファーマ	4.2	11,844
ロックフィールド	7.5	15,525	関東電化	12.9	11,829	ミルボン	6	36,900	東和薬品	5.3	14,808
日本たばこ産業	349	1,459,867	デンカ	117	67,860	ファンケル	3.3	20,856	富士製薬工業	3	15,720
ケンコーマヨネーズ	3.7	11,710	信越化学	105.5	1,080,320	コーセー	12.9	28,625	沢井製薬	2.6	10,205
うらべや日洋HD	4	12,560	日本カーバイド	68	11,016	シューズ・ホールディングス	9.6	122,016	ゼリア新薬工業	10.2	61,404
ヨロブナ	20.4	24,663	堺化学	17	7,191	ポーラ・オルビスHD	7.9	29,664	第一三共	11.9	20,848
ミヨシ油脂	61	8,906	エア・ウォーター	47.3	96,823	ノビアホールディングス	24.7	79,781	キョーリン製薬HD	171.6	423,251
理研ビタミン	1.5	6,720	太陽日酸	45	52,380	コニシ	3.4	18,462	大幸薬品	13.8	32,940
繊維製品 (0.7%)			日本化学工業	26	5,616	長谷川香料	9.8	15,444	ダイト	4	7,512
片倉工業	7.9	11,044	日本バーカライジング	29.7	50,074	星光PMC	7.5	17,070	大塚ホールディングス	3.8	8,876
グンゼ	44	17,160	高圧ガス	10.4	8,174	小林製薬	5.8	7,499	大正製薬HD	127.3	643,883
東洋紡	238	45,934	四国化成	9	12,420	荒川化学工業	16	111,520	ペパドリーム	12.4	111,600
ユニチカ	219	17,520	戸田工業	16	4,384	メック	5.5	11,005	日本コーク工業	11	71,390
富士紡ホールディングス	3.6	12,114	ステラ ケミファ	3.6	10,926	日本高純度化学	5.7	7,569	昭和シエル石油	78.6	7,624
倉敷紡績	59	15,753	保土化学工業	2.7	10,989	タカラバイオ	3.8	8,876	ニチレイ	52.6	55,650
シキボウ	63	8,694	日本触媒	9.2	62,928	JCU	16	24,464	シロ化学	9.2	11,509
日本毛織	12.6	11,088	大日精化	23	19,435	新田ゼラチン	4.2	17,220	富士石油	3.7	5,553
グイドーリミテッド	24.3	10,521	ナカバ	78	65,988	デクセラリアルズ	8.9	6,443	MORESCO	15.8	5,451
帝国繊維	6.4	12,185	三菱瓦斯化学	54.6	126,562	アース製薬	15.6	15,350	出光興産	3.8	7,687
帝人	47.7	99,072	三井化学	267	156,195	北興化学	4.4	26,928	JXTGホールディングス	28	91,280
東レ	425.2	395,223	JSR	58.9	112,263	大成ラミック	15	7,170	コスモエネルギーHLDGS	899.4	438,457
サカイ オーベックス	3.3	5,715	東京応化工業	11.2	44,576	クミアイ化学	3.5	10,276	ゴム製品 (1.0%)	19.2	31,200
住江織物	21	5,229	大阪有機化学	6.2	8,190	日本農薬	26.1	17,252	横浜ゴム	35.2	80,150
アヅギ	74	9,250	三菱ケミカルHLDGS	395.1	340,260	アキレス	15	9,795	東洋ゴム	32.3	70,510
セーレン	14.9	25,672	ダイセル	80.9	107,354	有沢製作所	4.8	9,196	ブリヂストン	198.4	960,851
ソニー	6.1	7,100	住友ベークライト	51	40,749	日東電工	12.2	10,235	住友化学	54.2	106,882
東海染工	53	7,102	積水化学	133	267,330	レック	42.4	379,649	藤倉ゴム	12.7	8,267
小松精練	11.9	9,020	日本ゼオン	50	58,050	きもと	4.8	14,928	オカモト	18	24,318
ワコールホールディングス	31	46,345	アイカ工業	17.7	59,826	藤森工業	26.2	6,550	ニッタ	5	17,000
ホギメディカル	3.7	28,601	宇部興産	294	79,674	前澤化成工業	4.5	15,502			
TSJホールディングス	23	17,595	積水樹脂	7.8	16,317		8.5	10,446			
三陽商会	56	9,016									

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5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
住友理工	10.5	12,379	東邦チタニウム	10.5	7,969	新川	7.1	4,813	日本精工	114.7	159,662
三菱ベルト	10	11,980	UACJ	96	27,648	ホソカワミクロン	2.6	12,649	NTN	133	69,825
バンドー化学	7.6	8,056	古河電工	20.1	105,123	ユニオンツール	2.7	9,207	ジェイテクト	56	98,368
ガラス・土石製品 (1.0%)			住友電工	221	397,026	オイス工業	6.9	13,372	不二越	58	33,096
日東紡績	48	25,872	フジクラ	75.7	74,337	サトーホールディングス	8.2	21,311	日本トムソン	19.6	12,191
旭硝子	292	268,932	昭和電線HLDGS	122	10,248	日精樹脂工業	6.2	6,813	THK	39.4	129,823
日本板硝子	32	27,360	タツタ電線	15.7	8,917	小松製作所	272.7	746,516	ユースン精機	3.3	9,401
日本山形硝子	34	6,188	リョービ	36	16,596	住友重機械	169	122,863	イーブル工業	6.2	11,209
日本電気硝子	119	94,724	アールステイ	9.3	10,127	日立建機	26.2	69,403	日本ピラー工業	7.1	11,942
住友大阪セメント	111	54,168	アサヒHD	8.8	16,579	巴工業	4.9	8,957	キッツ	27.8	26,104
太平洋セメント	359	131,394	金属製品 (0.7%)			井関農機	6.2	14,322	マキタ	73.1	311,406
日本ヒューム	8.7	5,855	稲葉製作所	0.8	1,126	TOWA	5.6	9,385	日立造船	42	22,302
日本コンクリート	17.4	6,820	宮地エンジニアリングG	31	7,843	丸山製作所	4.3	7,666	三菱重工業	95.4	422,240
アジアパイルHD	11.4	7,626	トーカコ	4.2	15,372	北川鉄工所	3.5	8,151	IHI	446	187,766
東海カーボン	58.6	34,046	SUMCO	63.1	120,836	ローツェ	2.7	7,651	スター精密	9.7	15,985
日本カーボン	3.6	10,980	川田テクノロジーズ	1.4	9,702	クボタ	279.1	518,009	電気機器 (13.2%)		
東洋炭素	3.7	7,207	東洋製罐グループHD	39.7	73,246	三菱化工機	21	5,229	日清紡ホールディングス	28.3	30,422
ノリタケ	3.4	12,444	ホッカンホールディングス	20	9,000	月島機械	9.7	12,154	イビデン	41.8	84,185
TOTO	42.9	187,687	横河リッジHLDGS	10.9	17,919	帝國電機製作所	6.7	7,805	コニカミノルタ	130.8	116,673
日本碍子	72.4	166,375	駒井ハルテック	2.8	6,431	新東工業	14.3	16,616	ブラザー工業	72.7	190,474
日本特殊陶業	50.7	121,274	三和ホールディングス	58.3	72,933	渋谷工業	5.4	18,927	ミネベアミツミ	105.7	203,049
MA RUWA	3.3	13,728	三和シヤッター	17	15,113	アイチ コーポレーション	9.2	7,212	日立	1,369	940,503
品川フラスコトリーズ	24	6,768	三協立山	7.9	13,240	小森コーポレーション	13.4	19,765	三菱電機	601.5	972,024
黒崎播磨	16	7,040	アルインコ	6.5	6,981	鶴見製作所	4.4	7,682	富士電機	1.7	106,908
フジミンコーポレテッド	5.1	11,378	LIXILグループ	82.8	226,292	住友精作	12	4,176	東洋電機製造	47	7,651
ニチアス	32	42,208	ノーリツ	11.3	24,973	荏原製作所	27.2	85,952	安川電機	65	156,650
ニチハ	8.1	33,817	長府製作所	6.3	17,841	西島製作所	7.5	8,160	シンフォニアテクノロジー	44	16,456
鉄鋼 (1.2%)			リンナイ	10	103,000	北越工業	10	9,280	明電舎	64	24,448
新日鐵住金	266.1	648,086	岡部	12.9	13,067	ダイキン工業	76.8	847,872	山洋電気	16	16,928
神戸製鋼所	105.6	109,718	ジエフト	6.2	13,020	オルガン	16	8,832	デンヨー	5.7	10,727
中山製鋼所	7.5	4,845	東プレ	11.1	34,798	トーヨーカネツ	32	9,856	東芝テック	38	23,674
合同製鐵	3.7	6,567	高周波熱線	11.7	12,039	栗田工業	32.7	100,389	芝浦メカトロニクス	22	7,612
JFEホールディングス	161.8	303,779	東京製鋼	4.5	7,812	椿本チエイン	31	30,039	マブチモーター	15.8	98,592
日新製鋼	18.9	23,020	パイオラックス	9.1	26,026	アナスト岩田	11.1	11,421	日本電産	73.3	863,840
東京製鐵	30.2	27,089	日本発条	54.6	65,356	ダイフク	28.3	100,465	東光高岳	4.5	7,465
共英製鋼	6.4	10,886	三益半導体	4.7	8,873	加藤製作所	3.6	11,466	ダブル・スコープ	6.7	11,926
大和工業	11.3	30,284	機械 (5.1%)			油研工業	38	8,816	ダイヘン	31	27,094
東京鐵鋼	16	6,768	日本製鋼所	20.5	34,194	タダノ	29.5	40,503	田淵電機	20.6	6,180
大阪製鐵	3	6,420	三浦工業	24.1	55,164	フジテック	15.8	20,508	JVCケンウッド	54.7	16,191
淀川製鋼所	7	21,210	タクマ	19.1	20,169	CKD	17.3	30,102	日新電機	12.6	16,531
東洋鋼板	14.8	5,890	ツガミ	17	13,702	キトー	8.2	9,561	大崎電機	13	11,258
丸一鋼管	19.4	64,796	オークマ	38	39,216	平和	17.2	42,466	オムロン	59.6	283,398
大同特殊鋼	98	60,956	東芝機械	35	17,815	理想科学工業	5	11,170	日東工業	7.5	13,777
日本高周波	87	7,047	アマダホールディングス	75.2	99,640	SANKYO	14.2	54,102	IDEC	12.6	19,479
日本冶金工	62.4	14,164	アイデンジニア	17	17,476	日本金銭機械	6.5	7,624	ジーエス・ユアサコーポ	107	54,784
山陽特殊製鋼	35	20,895	滝澤鉄工所	54	9,396	マースエンジニアリング	3.4	8,170	サクサホールディングス	30	6,060
愛知製鋼	3.3	14,091	富士機械製造	19	32,680	福島工業	3.8	16,492	メルコホールディングス	4.3	14,426
日立金属	59.7	87,997	牧野フライス	29	27,231	牧野電機	3.3	5,613	日本電気	806	233,740
大太平洋金属	36	10,440	オーエスジー	26.2	60,548	竹内製作所	10.5	19,614	富士通	550	451,825
新日本電工	46.8	18,813	旭ダイヤモンド	17.6	14,396	アノノ	17.4	43,587	沖電気	27.3	44,908
栗本鉄工所	2.9	5,684	DMG森精機	34.4	62,470	JUKI	9.9	14,176	電気工業	22	12,320
日本鑄鉄管	25	4,225	ソディック	14.3	17,317	サンデンホールディングス	41	12,505	サンケン電気	38	17,898
三菱製鋼	39	9,945	ディスコ	6.9	136,344	蛇の目マシン	7.3	6,752	アイホン	4.1	7,494
シンニツタン	5.3	3,694	日東工器	3.7	9,446	マックス	9	14,652	ルネサスエレクトロニクス	34.6	32,489
非鉄金属 (0.9%)			OKK	61	7,808	グローリー	17.7	66,640	セイコーエプソン	83.2	199,929
大紀アルミニウム	14	8,568	島精機製作所	8.1	42,849	新晃工業	4.7	8,798	ワコム	60.2	21,250
日本軽金属HD	128.6	33,821	フリュー	4.2	5,430	大和冷機工業	9.6	12,153	アルバック	9.9	62,271
三井金属	174	75,690	日阪製作所	6.5	6,194	セガサミーホールディングス	56	79,576	アクセル	4.7	3,722
東邦亜鉛	36	15,228	やまびこ	11.6	14,801	日本ピストンリング	4	9,112	EIZO	6.8	29,580
三菱マテリアル	37.1	115,937	ペガサスミシン製造	8.6	6,252	リケン	2.8	13,804	ジャパンディスプレイ	122.7	24,171
住友鉱山	155	204,755	ナブテスコ	30.4	102,448	TPR	5.8	21,982	日本信号	16.5	17,622
DOWAホールディングス	66	57,552	三井海洋開発	7	17,710	ツバキ・ナカシマ	6.6	13,576	京三製作所	21	11,235
古河機金	88	17,072	レオン自動車	6.6	6,415	ホンザキ	16.4	163,180	能美防災	7.3	11,227
大阪チタニウム	7.6	12,745	SMC	17.7	647,466	大豊工業	5	7,050	ホーチキ	5.8	9,419

銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
エレクトロ	千株	千円	浜松ホトニクス	千株	千円	エクセディ	千株	千円	任天堂	千株	千円
日本無線	6.1	14,682	三井ハイテック	41.4	148,833	豊田合成	7.4	23,421	三菱鉛筆	34.7	1,199,579
パナソニック	5.4	7,387	新光電気工業	8.8	11,651	愛三工業	17	47,039	タカラスタンダード	4.7	30,926
アンリツ	647.8	952,589	京セラ	21.5	19,651	エフ・シー・シー	9.8	8,839	ココロ	10.5	19,876
富士通ゼネラル	43.9	43,636	太陽誘電	92.4	607,252	シマノ	5.6	9,648	ナカバヤシ	29.2	44,121
日立国際電気	21	53,403	村田製作所	30.5	48,739	テイ・エス テック	9.4	20,727	グローバル	20	5,760
ソニー	15.1	40,166	コーシン	59	944,590	ジャムコ	22.5	391,950	岡村製作所	3.4	6,691
TDK	398	1,661,252	双葉電子工業	17.3	12,680	精密機器 (1.6%)	12.8	41,216	美津濃	18.9	19,693
帝国通信工業	32.1	224,700	北陸電気工業	8.8	17,450	テルモ	3.6	9,756	東京電力HD	30	18,900
タムラ製作所	51	10,761	ニチコン	57	7,866	日機装	85.7	390,792	中部電力	484.7	222,477
アルプス電気	52.5	169,312	日本ケミコン	65	25,350	島津製作所	20	21,620	関西電力	183.5	283,691
パイオニア	101.2	20,341	KOA	8.5	17,272	JMS	72.1	162,369	中国電力	234.8	384,954
日本電産工業	10.8	9,234	市光工業	17	12,138	ブイ・テクノロジー	23	7,314	北陸電力	70.5	90,310
日本トリム	1.8	7,695	小糸製作所	33.1	196,283	東京計器	1.2	27,396	東北電力	49.2	53,677
ローランド ディー・ジー	4.1	10,988	ミツバ	10.7	21,325	マナー	32	9,088	四国電力	139.7	233,997
フオスター電機	7.6	12,882	SCREENホールディングス	11.6	97,440	東京精密	10.8	42,930	九州電力	54.7	79,588
クラリオン	33	13,596	キャノン電子	4.3	9,288	ニコン	7.2	22,464	北海道電力	124.6	176,932
SMK	18	6,966	キャノン	303.1	1,195,123	トプコン	100.2	176,452	沖繩電力	52.6	45,972
ヨコオ	6.8	9,737	リコー	169	164,775	オリンパス	29.3	59,889	電源開発	9.35	25,609
ホシデン	19.7	26,279	東京エレクトロン	37.4	626,637	理研計器	90.5	376,480	イーレックス	45.6	133,380
ヒロセ電機	9	137,520	輸送用機器 (8.5%)			タムロン	5.6	11,194	東京瓦斯	8.4	9,164
日本航空電子	19	28,709	トヨタ紡織	19.6	43,708	HOYA	5	10,075	大阪瓦斯	601	357,114
TOA	7.9	8,208	ユニプレス	10.9	28,776	ノーリツ鋼機	115.1	654,343	東邦瓦斯	542	244,929
日立マクセル	8.9	19,980	豊田自動織機	49.9	294,909	エー・アンド・デイ	7.2	6,523	北海道瓦斯	21	121,800
古野電気	12.4	8,642	モリタホールディングス	10.8	18,986	シチズン時計	12.6	5,745	広島ガス	140	5,691
ユニテホールディングス	67	16,482	三桜工業	10.2	8,119	リズム時計	59.1	44,620	西部瓦斯	15.4	5,420
アルパイン	14.7	23,828	デンソー	137.2	662,813	大研医器	39	8,853	静岡ガス	63	16,947
スミダコーポレーション	7.1	12,233	東海理化電機	14.2	29,635	メニコン	6.7	5,199	メタウォーター	15.3	12,010
アイコム	5.4	14,542	三井造船	197	30,535	松風	4.1	14,719	SBSホールディングス	3.3	10,197
リオン	3.4	5,644	川崎重工	441	144,207	セイコーHD	38.3	59,288	相鉄ホールディングス	298	183,270
船井電機	6.7	5,989	名村造船所	17.3	10,864	ニホンフラッシュ	5.4	26,379	東京急行	89	49,840
横河電機	60.5	117,733	日本車輛	34	9,894	前田工業	3.8	5,601	京浜急行	304	259,312
新電元工業	24	13,296	日産自動車	664.2	717,336	永大産業	6.9	10,846	小田急電鉄	153	213,588
アズビル	16.5	69,217	いすゞ自動車	163.1	224,670	アートネイチャー	13	6,643	京王電鉄	89.9	210,276
日本光電工業	23	56,511	トヨタ自動車	681.8	4,068,982	ダンロップスポーツ	8.2	6,027	京成電鉄	154	147,378
共和電業	15.4	6,899	日野自動車	80.6	105,989	バンダイナムコHLDGS	4.4	4,791	富士急行	40.6	119,607
堀場製作所	11.1	80,364	三菱自動車工業	215.7	159,402	共立印刷	61.9	251,623	新京城電鉄	16	19,536
アドバンテスト	38.6	79,438	エフテック	6.5	8,924	S HOE I	27.1	9,186	東日本旅客鉄道	13	5,473
エスベック	5.5	9,119	武蔵精密工業	6.9	20,734	SHOEI	27.1	9,186	西日本旅客鉄道	108.5	1,189,160
キーエンス	25.5	1,320,645	日産車体	24.1	26,895	パイロットコーポレーション	3.1	8,549	東海旅客鉄道	54	429,030
日置電機	3.5	7,917	新明和工業	23	20,677	萩原工業	7.2	7,041	西武ホールディングス	46.5	868,852
シスメックス	43.5	294,495	極東開発工業	11.6	21,483	トッパン・フォームズ	9.2	41,492	鴻池運輸	79.2	173,368
日本マイクロニクス	13.5	15,957	日信工業	12.1	21,792	フジールインターナショナル	2.5	6,812	西日本鉄道	7.9	12,410
メガチップス	6.1	16,415	トピー工業	4.7	15,322	タカラトミー	9.1	10,992	ハマキョウレックス	63	31,059
OBARA GROUP	3.4	20,570	ティラド	27	9,342	大建工業	12.7	37,363	サカイ引越センター	4.3	10,973
コーセル	8.7	12,493	曙ブレーキ	38.1	13,449	凸版印刷	24.3	35,210	近鉄グループHLDGS	563	250,535
イリソ電子工業	2.8	24,640	タチエス	9.9	19,839	大日本印刷	4.4	10,480	阪急阪神HLDGS	70.9	288,917
オプテックスグループ	5.3	20,458	NOK	26.7	65,334	共同印刷	151	189,807	南海電鉄	118	72,334
千代田インテグレ	3.4	7,782	フタバ産業	21.7	20,289	日本写真印刷	155	194,835	京阪ホールディングス	121	92,565
レーザータック	12.8	21,619	K Y B	6.3	35,343	光村印刷	10.5	31,815	神戸電鉄	18	7,236
スタンレー電気	39.8	136,116	大同メタル工業	7.7	7,515	宝印刷	30	7,830	名古屋鉄道	203	107,387
岩崎電気	48	8,400	プレス工業	30.4	15,595	アックス	3.7	6,219	山陽電鉄	23	13,225
ウシオ電機	34.1	49,786	太平洋工業	11.9	17,683	ツツミ	55.3	108,609	日本通運	209	149,226
日本セラミック	5.3	14,235	ケーヒン	12.5	19,675	ヤマハ	1.9	4,088	ヤマトホールディングス	100.5	248,536
遠藤照明	10.7	12,123	河西工業	8.1	11,477	河合楽器	38.3	139,986	山丸	69	49,404
古河電池	13	10,244	アイシン精機	51.4	287,326	クリナップ	2.9	6,896	丸全昭和運輸	16	7,280
山一電機	6.5	12,493	マツダ	179.8	272,756	ピジョン	7.8	6,567	センコーグループHLDGS	25.1	17,544
図研	5.9	9,658	今仙電機製作所	8.3	10,267	キングジム	34.1	135,377	トナミホールディングス	15	6,705
日本電子	25	14,925	本田技研	504.8	1,573,461	リントック	7.8	7,160	ニッコンホールディングス	17.1	43,929
カシオ	46	79,856	スズキ	112	614,544	イーケー	12.3	33,062	福山通運	31	23,343
ファナック	56.7	1,266,961	SUBARU	172.8	656,985	エントラ	12.6	9,601	セイロホールディングス	37.9	56,281
日本シイエムケイ	15.8	13,761	ヤマハ発動機	78.9	231,887						
エンプラス	2.5	8,300	ショーフ	21.9	23,958						
ローム	27.2	248,064	T B K	17	8,789						

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
神奈川中央交通	千株	千円	オービック	千株	千円	フィールズ	千株	千円	カナデン	千株	千円
日立物流	8	5,864	ジャストシステム	19.2	125,184	双日	4.4	5,266	菱電商事	6.5	7,273
丸和運輸機関	11.7	30,899	TDCソフトウェアアジア	9.8	17,091	アルフレックスホールディングス	317.7	85,143	岩谷産業	8	6,408
九州旅客鉄道	1.7	5,746	ヤフー	4.6	5,920	アルフレッサホールディングス	65.4	143,487	すてきなスイスグループ	59	42,952
海運業 (0.2%)			トレンドマイクロ	408.1	203,233	横浜冷凍	14.3	15,658	三菱石油	45	6,660
日本郵船	496	102,176	日本オラルク	29.5	167,560	山下医科器械	3.3	5,722	稲桐産業	13.7	14,617
商船三井	299	98,969	フューチャー	9.3	62,031	AIJホールディングス	5.1	10,026	ワキタ	8.5	11,874
川崎汽船	212	62,964	CAC HOLDINGS	10.2	9,016	あいホールディングス	3.2	14,512	東邦ホールディングス	12.2	15,201
N Sユニテッド海運	30	6,930	ソフトバンク・テクノ	5.8	6,194	ディー・ブイエックス	8.6	25,679	サンゲツ	17.3	39,807
飯野海運	30.2	14,163	オービックビジネス	4.8	8,708	ダイワボウHD	5.6	7,218	ミツウロコグループ	15.3	31,288
空運業 (0.5%)			伊藤忠テクノソリューションズ	2.9	16,849	マクニカ・富士EHL L D G S	68	28,356	シナネンホールディングス	7.8	5,655
日本航空	98.4	320,685	アイティフォー	12.6	48,510	パイタルK S K HD	10.5	17,178	伊藤忠エネクス	1.6	3,600
ANAホールディングス	1,039	389,625	大塚商会	12.7	7,950	UK Cホールディングス	9.4	9,127	サンリオ	9.4	8,864
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			サイボウズ	14.9	102,363	TOKAIホールディングス	3.5	6,912	リョーサン	16.7	35,571
トランコム	1.8	10,422	ソフトブレイン	12.5	6,137	三洋貿易	24.8	20,881	新光商事	7.7	32,186
日新	26	12,714	電通国際情報 S	10.1	5,383	ワイン・パートナーズ	4.9	11,034	トーホー	5	6,790
三菱倉庫	35	50,785	デジタルガレージ	3.8	10,138	シップヘルスケアHD	5.5	6,759	三信電気	3.1	9,408
三井倉庫 HOLD	34	10,948	ウェザーニューズ	11.3	23,040	コムダホールディングス	10.6	33,867	東陽テクノカ	6.3	9,084
住友倉庫	39	29,328	C E J	1.9	7,448	小野建	10.2	20,032	モスフード サービス	8.3	8,930
渋沢倉庫	28	10,164	WOWOW	16.3	9,405	佐島電機	5.5	9,212	加賀電子	7	24,290
東陽倉庫	28	8,344	ネットワンシステムズ	3	10,005	伯東	7	5,579	P A L T A C	5.4	11,577
日本トランスシティ	18	8,208	アルゴグラフィックス	30	33,000	コンドレーツク	6.8	9,390	ヤマタネ	9.1	37,128
東洋埠頭	43	7,783	マーベラス	6.1	16,268	ナガイレーベン	7.9	7,315	丸紅建材リース	6	9,294
上組	66	77,880	Eiベックス・グループHD	10.4	12,407	三菱食品	8.1	20,930	日鉄住金物産	28	6,160
キユーシー流通システム	2.3	6,173	日本ユニシス	10.3	14,935	松田産業	5.8	19,894	トラスコ中山	4.1	21,402
郵船ロジスティクス	5.7	5,876	兼松エレクトロニクス	17.1	32,763	第一興商	4.8	7,262	オートバックスセブン	12.8	31,974
近鉄エクスプレス	10	18,100	東京放送HD	9	13,072	メディアバルHD	9	48,510	加藤産業	18.2	32,468
東海運	12.7	5,486	日本テレビH L D S	34.7	68,914	萩原電気	54.8	114,532	イノテック	8.6	26,230
内外トランスライン	3.6	4,464	テレビ朝日HD	50.3	91,747	アズワン	3.3	7,560	イエロハット	10.4	6,988
情報・通信業 (8.1%)			スカパーJ S A T H D	15.3	30,737	シモジマ	4.4	23,804	日伝	5.5	14,916
N E C ネットエスアイ	6	15,264	テレビ東京HD	35	17,710	ドゥンシャ	6.2	7,173	因幡電機産業	2.5	8,937
システム	5.2	12,038	ワイヤレスゲート	5	11,495	小津産社	7	14,770	ミスミグループ本社	7.2	30,384
デジタルアーツ	3	12,075	コネクショ	4.5	7,011	黒田電気	2.6	5,730	スズケン	62.5	157,812
新日鉄住金 S O L	9.4	25,145	日本通信	4.9	9,550	丸文	7.4	16,102	ジェコス	24.9	88,519
ソフトクリエイトHD	5.7	8,145	日本電信電話	66.1	11,038	ハピネット	1.7	1,285	ロソーン	5	5,890
T I S	18.5	60,495	K D D I	445.6	2,382,623	日本ライフライン	5.8	12,620	サンエー	18.4	140,760
電算システム	3	5,220	光通信	548.6	1,685,847	エクセル	6.7	26,766	カワチ薬品	4.2	21,840
グリー	39.8	37,531	N T T ドコモ	6.7	76,179	マルカキカイ	3.4	4,923	エーピーシー・マート	4.6	12,742
三菱総合研究所	12.5	29,837	エムティアーアイ	406.6	1,112,051	I D O M	3.5	6,632	ハードオフコーポレーション	10.2	67,932
ファンデックス	2.5	7,850	GMOインターネット	9.6	6,182	進和	18.9	11,831	アスフル	4.4	4,884
K L a b	6.2	5,815	カドカワ	21.9	32,915	シークス	3.1	6,193	ジオホールディングス	6.1	20,435
ポルトワイン・ビッフル	12.2	18,788	学研ホールディングス	17.7	24,797	伊藤忠	4.1	18,798	アダストリア	9.1	10,692
ネクソン	6.2	9,647	ゼンリン	2.4	7,692	丸紅	546	373,737	くらコーポレーション	9.1	26,417
アイスタイル	60.9	133,858	松竹	8.4	23,192	高島	546	373,737	キャンテック	3.7	17,649
エイチーム	13.2	13,332	東宝	37	52,466	長瀬産業	33	6,996	パルグループH L D G S	4.3	7,400
テクノスジャパン	4.8	15,264	東映	36.2	122,718	蝶理	28.4	46,008	エディオン	3.1	8,701
コロプラ	4.9	5,654	N T T データ	20	21,220	豊田通商	61.1	209,878	サーコーポレーション	20.8	22,276
ブロードリーフ	20.1	24,260	D T S	34.7	212,711	兼松	116	25,868	ワッツ	7.8	5,241
ハーコユニテッドグループ	18.3	13,542	スクウェア・エニックス・HD	6	20,010	三井物産	501.4	759,370	ハロース	6.9	8,887
ティーガイア	4.8	8,006	シーイーシー	21.5	79,872	日本紙パルプ	28	11,564	あみやき亭	2.1	5,004
豆蔵ホールディングス	5.6	11,592	カプコン	3.9	9,274	日立ハイテックロジーズ	19.3	86,560	ひらまつ	1.5	6,195
かんホー・オライヴ・インター	7.7	8,192	ジャストテック	13.5	35,532	カイメイ	6.1	8,442	ゲンキー	10.7	7,104
GMOペイメントゲートウェイ	5.2	9,651	S C S K	4.8	5,774	O U Gホールディングス	28	7,392	大黒天物産	2.6	7,865
インターネットイニシアティブ	122.7	34,846	アイネット	15.2	74,632	スターゼン	2.4	11,196	ハニスホールディングス	1.5	8,400
さくらインターネット	4.7	31,255	T K C	8.2	9,397	山善	17.7	19,930	アルペン	6	7,020
S R Aホールディングス	10.3	22,515	富士ソフト	17.9	53,793	住友商事	354.7	518,039	クウォール	4.3	8,483
朝日ネット	6.2	5,766	N S D	12.2	25,034	内田洋行	2.6	6,770	ジーンズ	6.6	11,543
コムテュア	3	9,150	コナミホールディングス	25.2	142,632	三菱商事	420	938,910	ビックカメラ	3.9	25,662
g u m i	16.3	8,019	福井コンピュータH L D S	2	7,150	第一実業	15	9,150	DCMホールディングス	31.3	37,591
L I N E	1.5	7,267	J B C Cホールディングス	12.8	10,752	キャンマークeting J P N	15.6	37,315	Mo n o t a r O	32.7	32,307
野村総合研究所	7.9	10,641	ミロク情報サービス	5.2	12,454	西華産業	23	8,648	アークランドサービスHD	20.4	80,070
インターゼホールディングス	12.7	51,689	ソフトバンクグループ	249.7	2,281,009	菱洋エレクトロ	4	7,881	J. フロントリテイリング	2.6	9,581
フジ・メディア・HD	41.2	179,220	卸売業 (4.2%)			ユアサ商事	4	13,660	ドトール・日シH D S	69.8	115,100
	3.7	8,132	エレマテック	2.6	4,682	神鋼商事	1.8	4,555	マツモトキヨシHD	9.5	22,857
	57.5	87,802	あらた	2.9	10,512	阪利興業	55	43,065		10.4	70,824

銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
ブロンコビリー	千株	千円	リンガーハット	千株	千円	山形銀行	千株	千円	大和証券G本社	千株	千円
スタートトゥデイ	3.3	8,883	AOKIホールディングス	6.9	16,842	岩手銀行	30	14,850	野村ホールディングス	498	337,594
物語コーポレーション	51.2	151,859	オークワ	9.8	14,582	東邦銀行	3.4	15,028	岡三証券グループ	1,143.3	783,160
ココカラファイン	2	10,920	コム	8	9,800	東北銀行	48	19,008	丸三証券	38	26,562
三越伊勢丹HD	5.9	34,397	青山商事	8.5	24,684	みちのく銀行	64	9,600	東洋証券	17.3	15,691
ウェルシアHD	110.1	126,394	しまむら	10.7	43,014	ふくおかフィナンシャルG	58	10,672	東海東京HD	29	7,279
クリエイトSDH	14.4	60,912	高島屋	6.5	93,015	静岡銀行	222	115,884	光世証券	61.1	36,721
丸善CH1 HD	7.8	20,966	松屋	92	101,476	十六銀行	146	137,240	水戸証券	28	4,816
テムシー	13	4,550	エフ・ツー・オーレテリング	11.1	10,900	スルガ銀行	62	20,832	いちよし証券	26.7	8,597
ジョイフル本田	2	5,544	近鉄百貨店	25.8	51,109	八十二銀行	56.9	142,932	松井証券	13	11,973
鳥貴族	8.7	33,103	丸井グループ	23	8,303	山梨中央銀行	103.1	67,942	マネックスG	29.1	26,859
すかいらーく	3	8,349	アグリアル リテイリング	58.5	99,274	大垣共立銀行	32	14,560	カブドットコム証券	59.7	16,716
綿半ホールディングス	23.6	41,819	イズミ	3.8	16,796	福井銀行	85	27,030	極東証券	23.2	8,676
ユニテッド・スーパーマケ	3.3	6,623	イオン	226.9	387,885	北国銀行	50	13,950	岩井コスモホールディング	7.3	12,249
ブックオフコーポレーション	17.7	20,001	平和堂	11.1	70,707	清水銀行	56	22,736	藍澤證券	6.6	7,926
あさひ	10.2	7,945	フジ	11.1	27,361	滋賀銀行	2.4	8,544	マネーパートナーズGP	11.1	7,625
日本調剤	5.1	7,124	ヤオコー	6.3	18,144	京都銀行	49	27,979	保険業 (2.6%)	10.8	5,432
コスモス薬品	2.1	8,011	ゼオホールディングス	6.1	29,585	紀陽銀行	5.3	16,986	かんぽ生命保険	20.5	49,753
一六堂	2.8	67,424	ケーズホールディングス	24.7	57,081	三重銀行	47	21,620	SOMPOホールディングス	115.7	506,534
セパン&アイ・HL DGS	22.1	8,574	アインホールディングス	7	63,560	鳥取銀行	98	94,766	アニコムホールディングス	4.9	11,020
薬王堂	3.4	11,747	元気寿司	7	63,560	紀陽銀行	19.5	36,738	M&A D	164.5	656,848
クリエイト・レストランツ・ホール	14.5	14,746	ヤマダ電機	3.2	7,187	三重銀行	3.3	7,689	S O N Y F H	52.8	91,080
ツルハホールディングス	11.4	147,516	アーランドサカモト	183.8	107,890	ほくほくフィナンシャルG	35.7	59,083	第一生命HL DGS	335.4	636,421
サンマルクホールディングス	3.6	12,438	ニトリホールディングス	9.8	14,298	広島銀行	160	74,720	東京海上HD	222.4	1,081,753
トリドールホールディングス	7.1	20,469	吉野家ホールディングス	24.3	411,642	山陰合同銀行	31.1	26,870	T & Dホールディングス	202	324,917
ダイユー・リックHL DGS	3.6	7,419	松屋フーズ	22.6	41,629	中国銀行	38.1	61,074	アドバンスクリエイト	3.5	6,695
クサリのアオキHL DGS	9.5	7,419	サガミチェーン	2.8	11,788	鳥取銀行	4.2	7,039	その他金融業 (1.3%)	16.3	76,936
総合メディカル	4.8	26,832	関西スーパーマーケット	8.5	11,968	伊予銀行	73.6	60,572	クレディセゾン	41.4	87,602
ノジマ	3	15,090	王将フードサービス	6	9,744	百十四銀行	59	21,358	芙蓉総合リース	6.3	37,674
カッパ・クリエイト	8.7	15,338	プレナス	4	16,620	四国銀行	43	13,674	興銀リース	10.5	26,649
ライトオン	8.4	10,794	ミニストップ	6	14,250	阿波銀行	45	34,965	東京センチュリー	10.8	46,548
良品計画	5	5,145	アークス	3.7	8,632	大分銀行	33	14,355	日本証券金融	15.3	8,782
アドヴァン	7.4	225,700	パローホールディングス	10.3	25,513	宮崎銀行	38	14,250	アイフル	108.2	36,463
アルビス	4.9	5,693	ベルク	12	31,416	佐賀銀行	30	8,400	リコーリース	4.5	15,637
コナカ	2.1	10,059	大庄	2.6	13,260	十八銀行	27	8,505	イオンフィナンシャルサービス	37	86,136
コーナン商事	12.3	7,453	ファーストリテイリング	4.6	7,854	沖繩銀行	4.9	21,364	アコム	117.5	56,517
ワタミ	7	16,801	サンドラッグ	9.3	35,516	琉球銀行	11.8	17,971	ジャックス	32	15,680
ドンキホーテホールディング	8	11,096	サクパスホールディング	21.3	96,276	セブ銀行	221	93,704	オリコ	127.8	24,537
西松屋チェーン	35.8	158,773	ペルーナ	7	8,610	みずほフィナンシャルG	7,595.1	1,496,234	日立キャピタル	13.1	35,605
ゼンショーホールディングス	10.1	11,998	銀行業 (7.7%)	14.9	19,936	高知銀行	68	8,704	オリックス	393	704,845
幸楽苑ホールディングス	29.4	61,740	じもとホールディングス	48.6	9,963	山口フィナンシャルG	49	64,533	三菱UFJリース	141.2	82,602
サイゼリヤ	6	11,544	めびきフィナンシャルG	264.2	116,248	長野銀行	3.2	6,268	日本取引所グループ	172.3	328,231
V Tホールディングス	9	29,655	東京TYフィナンシャルG	8.1	24,664	名古屋銀行	2.8	11,606	イー・ギャランティ	2.7	7,103
ポプラー	20.5	11,623	九州フィナンシャルG	90.5	64,074	北洋銀行	86.1	33,665	NECキャピタルソリューション	2.9	4,947
ユニテッドアローズ	15.3	8,782	富山第一銀行	153	213,894	愛知銀行	1.9	12,312	いちご	58.7	19,136
ハニデイ高	8.1	28,552	富山第二銀行	15.8	8,152	第三銀行	4.2	7,182	日本駐車場開発	71.1	11,233
京都きもの友禅	6.3	15,208	コンルディア・フィナンシャル	35.9	190,747	中京銀行	2.7	6,280	ヒューリック	115.7	123,336
ココワイド	10.7	9,908	りそなホールディングス	36.8	40,700	大光銀行	30	6,990	野村不動産HL DGS	40	95,720
壱番屋	18.1	34,534	西日本フィナンシャルHD	648.5	378,659	愛媛銀行	5.4	9,107	三重交通グループHD	11.9	4,700
スキホールディングス	3.3	12,556	新生銀行	115.1	437,610	トマト銀行	6	5,705	サムティ	5.6	6,680
スクロール	12	73,920	あおぞら銀行	444	1,829,724	みなと銀行	29.1	14,259	日本商業開発	3.9	6,306
ヨドシホールディングス	12	4,572	三菱UFJフィナンシャルG	4,202.1	2,989,153	東和銀行	2.4	7,464	フランスコーポレーション	9.3	14,108
ユニー・ファミリーマートHD	5.1	13,713	りそなホールディングス	648.5	378,659	福島銀行	116	14,500	ユニゾホールディングス	5.3	15,173
木曾路	24.5	152,145	三井住友トラストHD	115.1	437,610	大東銀行	92	8,188	日本管理センター	4.6	6,131
サトレストラシスシステムズ	7	18,543	三井住友フィナンシャルG	444	1,829,724	トモニホールディングス	45	7,425	フージャースHD	13	11,544
千趣会	13.2	11,893	第四銀行	66	32,472	フィデアホール	35.9	20,139	オープンハウス	8.3	29,382
ケーヨー	9.6	7,929	北越銀行	6	16,374	池田泉州HD	65.9	12,389	東急不動産HD	130.6	88,416
上新電機	13.3	9,695	千葉銀行	21.2	162,604	証券・商品先物取引業 (1.1%)	55.7	25,454	飯田GHD	46.1	85,192
日本瓦斯	13	19,565	群馬銀行	120.4	74,046	F P G	20.7	20,844	パーク24	28.7	84,177
ロイヤルホールディングス	10.3	39,964	武蔵野銀行	8.4	28,728	S B Iホールディングス	61.5	91,389	パワカ	2.7	5,491
いなげや	8.8	21,560	千葉興業銀行	18.4	10,782	ジャフコ	9.3	41,478	三井不動産	296.6	792,515
島忠	6.4	12,556	筑波銀行	28.6	9,323				三菱地所	416.1	887,749
チヨダ	13.5	36,072	七十七銀行	83	41,749						
ライフコーポレーション	6.1	17,738	青森銀行	44	17,336						
	4.2	13,251	秋田銀行	27	8,991						

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2017年6月5日現在		銘柄	2017年6月5日現在	
	株数	評価額		株数	評価額
平和不動産	10.7	20,201	シーティーエス	9.8	11,975
東京建物	63.9	100,898	みらかホールディングス	14.8	71,410
ダイビル	13.9	16,179	アルプス技研	2.6	10,010
京阪神ビルディング	11.5	7,785	オリエンタルランド	63.4	477,528
住友不動産	136	471,648	ダスキン	14.5	41,934
大京	102	23,358	明光ネットワークジャパン	9	13,086
テオオーシー	21.7	22,936	ファルコホールディングス	6.4	9,651
東京楽天地	13	7,423	ラウンドワン	22.7	25,514
レオパレス21	69.3	44,975	リゾートトラスト	23.2	49,114
スターツコーポレーション	6.5	17,641	ビー・エム・エル	7.7	17,509
フジ住宅	9.2	6,706	りらいあコミュニケーション	10.5	12,915
空港施設	9.2	5,538	リソー教育	11.5	10,867
ゴールドクレスト	5.2	12,355	ユー・エス・エス	71.1	161,752
日神不動産	8.9	5,224	サイバーエージェント	35.8	140,694
タカラレーベン	25.2	13,028	楽天	307.1	428,097
サンヨーハウス名古屋	6.3	7,087	テー・オー・ダブリュー	5.3	4,467
イオンモール	35.4	75,685	セントラルスポーツ	3.1	13,237
ファースト住建	3.5	5,467	フルキャストホールディングス	7.1	9,698
トーセイ	9.3	7,402	テクノロ・ホールディング	9.8	45,619
エヌ・ティ・ティ都市開発	34.2	38,475	ジャパンマテリアル	4.6	9,673
サンフロンティア不動産	6.5	7,865	ペクトル	6.8	11,736
エフ・ジェー・ネクスト	8	6,432	アサンテ	3.6	6,699
グランディハウス	12	5,148	N・フィールド	5.6	8,181
日本空港ビルディング	17.6	82,104	リクルートホールディングス	128.5	771,000
サービス業 (4.0%)			日本郵政	146.5	199,826
日本工営	3.8	12,065	ベルシステム24HLDGS	11.3	12,023
L i f e l l	16.4	11,758	リログループ	29.5	67,289
ジェイエイシーリクルートメント	4.3	7,176	東祥	2	11,020
日本M&Aセンター	17.2	77,830	エイチ・アイ・エス	11.1	35,298
タケエイ	7.4	8,465	共立メンテナンス	9.8	33,712
トラスト・テック	3.3	3,738	イチネンホールディングス	8.3	9,910
パソナグループ	6.1	5,874	建設技術研究所	6.2	7,099
CDS	8	11,208	東京アトル	67	9,581
リンクアンドモチベーション	18.3	15,536	タナベ経営	3.7	5,168
GC A	7.5	6,922	ナガワ	1.2	4,848
エス・エム・エス	8.6	27,950	よみうりランド	15	6,900
デンブホールディングス	46	101,338	東京都競馬	40	9,960
リニカル	4	6,792	常盤興産	5.2	9,588
クックパッド	14.7	13,597	カナモト	8.7	30,406
スタジアオアリス	2.9	6,913	東京ドーム	23.1	23,446
シミックホールディングス	3.9	5,522	西尾レントオール	5.2	17,212
総合警備保障	21.3	113,529	トランス・コスモス	7	16,681
カカココム	43.3	70,059	乃村工藝社	12.9	31,295
ルネサンス	4.7	9,583	藤田観光	25	9,200
ディップ	8	20,728	KNT-CTホールディングス	39	5,694
オプトホールディング	8.6	12,581	日本管財	4.4	8,465
新日本科学	12.4	7,750	トーカイ	2.6	11,622
ツクイ	21.5	14,727	セコム	60.1	505,501
エムスリー	51.5	171,495	セントラル警備保障	3.2	6,080
アウトソーシング	4.3	22,059	丹青社	10.9	12,938
ウエルネット	6.9	10,653	メイテック	6.3	30,366
ディー・エヌ・エー	28	68,320	アサツー ディ・ケイ	8.5	23,766
博報堂DYHL DGS	81	122,553	応用地質	6.3	9,796
ぐるなび	8.8	17,696	船井総研ホールディング	8.2	21,590
エスアールジータカミヤ	10.1	5,676	学究社	3.9	5,928
ジャパンベストレスキュー	31.2	8,268	ベネッセホールディングス	19.7	82,543
ファンコミュニケーションズ	17.9	18,114	イオンディライト	6	22,080
ティア	9.9	7,741	ニチイ学館	14.2	15,265
インフォマート	28.7	24,997	ダイセキ	10.2	25,469
J Pホールディングス	27.4	8,247			
E P Sホールディングス	7.6	12,996			
プレステージ・インター	12	13,848			
アミューズ	3.9	11,817			
ドリムインキュベータ	3.1	6,587			
クイック	4.4	6,512			
ケネディクス	76.6	42,896			
電通	65.7	376,461			
イオンファンタジー	1.9	6,241			
合 計			株数・金額	84,666.05	131,873,348
			銘柄数<比率>	1,490銘柄	<98.9%>

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2017年6月5日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円 1,270	百万円 -
TOPIX		

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付および借入状況

区分	2017年6月5日現在	
	貸付	借入
株式	株 4,764,100 (1,009,300)	株 -

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
(注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券へ1,009,300株を貸付しています。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ・ライフ・バランス５０）が投資対象としている「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の決算日（２０１６年１１月３０日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（２０１７年６月５日）現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の組入資産の内容等を２０～２３ページに併せて掲載いたしました。

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

（２０１６年６月７日から２０１７年６月５日まで）

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
346	10年国債 0.1% 2027/3/20	190,146	127	5年国債 0.1% 2021/3/20	242,073
344	10年国債 0.1% 2026/9/20	181,967	363	2年国債 0.1% 2018/4/15	206,304
368	2年国債 0.1% 2018/9/15	174,145	342	10年国債 0.1% 2026/3/20	166,320
129	5年国債 0.1% 2021/9/20	166,792	365	2年国債 0.1% 2018/6/15	147,464
345	10年国債 0.1% 2026/12/20	160,612	340	10年国債 0.4% 2025/9/20	135,251
343	10年国債 0.1% 2026/6/20	155,916	124	5年国債 0.1% 2020/6/20	125,975
128	5年国債 0.1% 2021/6/20	149,414	362	2年国債 0.1% 2018/3/15	124,494
130	5年国債 0.1% 2021/12/20	148,645	344	10年国債 0.1% 2026/9/20	122,502
365	2年国債 0.1% 2018/6/15	147,809	341	10年国債 0.3% 2025/12/20	112,879
335	10年国債 0.5% 2024/9/20	146,072	333	10年国債 0.6% 2024/3/20	107,014

（注１）金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

（注２）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、２０１７年６月５日現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）（１２,３３８,２１１千円）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	２０１７年６月５日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちＢＢ格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					５ 年 以 上	２ 年 以 上	２ 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	10,923,000	12,142,154	77.7	—	54.3	17.8	5.7
地方債証券	1,200,000	1,236,362	7.9	—	4.6	2.0	1.3
特殊債券(除く金融債券)	900,000	925,804	5.9	—	2.0	2.6	1.3
金融債券	100,000	100,047	0.6	—	—	0.6	—
普通社債券	1,100,000	1,127,596	7.2	—	1.4	4.6	1.3
合 計	14,223,000	15,531,965	99.4	—	62.2	27.6	9.6

（注１）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

（注２）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 国内 (邦貨建) 公社債 (銘柄別)

2017年6月5日現在						
区 分	銘 柄	年利率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
国債証券	368	2年国債	0.1000	140,000	140,446	2018/09/15
	114	5年国債	0.3000	62,000	62,363	2018/09/20
	296	10年国債	1.5000	35,000	35,744	2018/09/20
	40	20年国債	2.3000	51,000	52,611	2018/09/20
	370	2年国債	0.1000	10,000	10,036	2018/11/15
	371	2年国債	0.1000	125,000	125,486	2018/12/15
	116	5年国債	0.2000	155,000	155,846	2018/12/20
	297	10年国債	1.4000	20,000	20,475	2018/12/20
	298	10年国債	1.3000	61,000	62,357	2018/12/20
	373	2年国債	0.1000	125,000	125,540	2019/02/15
	300	10年国債	1.5000	8,000	8,236	2019/03/20
	41	20年国債	1.5000	40,000	41,180	2019/03/20
	42	20年国債	2.6000	22,000	23,081	2019/03/20
	376	2年国債	0.1000	20,000	20,097	2019/05/15
	119	5年国債	0.1000	41,000	41,205	2019/06/20
	301	10年国債	1.5000	35,000	36,175	2019/06/20
	302	10年国債	1.4000	54,000	55,703	2019/06/20
	120	5年国債	0.2000	10,000	10,078	2019/09/20
	121	5年国債	0.1000	55,000	55,302	2019/09/20
	43	20年国債	2.9000	14,000	14,976	2019/09/20
	122	5年国債	0.1000	100,000	100,611	2019/12/20
	305	10年国債	1.3000	100,000	103,666	2019/12/20
	123	5年国債	0.1000	100,000	100,670	2020/03/20
	306	10年国債	1.4000	10,000	10,428	2020/03/20
	44	20年国債	2.5000	32,000	34,351	2020/03/20
	45	20年国債	2.4000	20,000	21,413	2020/03/20
	124	5年国債	0.1000	35,000	35,245	2020/06/20
	308	10年国債	1.3000	100,000	104,358	2020/06/20
	309	10年国債	1.1000	103,000	106,860	2020/06/20
	46	20年国債	2.2000	19,000	20,351	2020/06/22
	125	5年国債	0.1000	150,000	151,138	2020/09/20
	310	10年国債	1.0000	30,000	31,119	2020/09/20
	311	10年国債	0.8000	42,000	43,289	2020/09/20
	47	20年国債	2.2000	23,000	24,766	2020/09/21
	126	5年国債	0.1000	154,000	155,258	2020/12/20
	312	10年国債	1.2000	94,000	98,424	2020/12/20
	48	20年国債	2.5000	9,000	9,839	2020/12/21
	313	10年国債	1.3000	34,000	35,834	2021/03/20
	314	10年国債	1.1000	77,000	80,569	2021/03/20
	49	20年国債	2.1000	4,000	4,338	2021/03/22
	50	20年国債	1.9000	30,000	32,312	2021/03/22
	128	5年国債	0.1000	147,000	148,340	2021/06/20
	315	10年国債	1.2000	90,000	94,797	2021/06/20
	316	10年国債	1.1000	56,000	58,758	2021/06/20
	51	20年国債	2.0000	25,000	27,145	2021/06/21
	129	5年国債	0.1000	130,000	131,232	2021/09/20
	317	10年国債	1.1000	40,000	42,094	2021/09/20
	318	10年国債	1.0000	33,000	34,585	2021/09/20
	52	20年国債	2.1000	19,000	20,809	2021/09/21
	130	5年国債	0.1000	147,000	148,508	2021/12/20
	319	10年国債	1.1000	140,000	147,723	2021/12/20
	320	10年国債	1.0000	35,000	36,771	2021/12/20
	53	20年国債	2.1000	13,000	14,306	2021/12/20

2017年6月5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		
	54	20年国債	2.2000	14,000	15,470	2021/12/20
	131	5年国債	0.1000	80,000	80,807	2022/03/20
	321	10年国債	1.0000	65,000	68,452	2022/03/20
	322	10年国債	0.9000	140,000	146,763	2022/03/20
	55	20年国債	2.0000	41,000	45,151	2022/03/21
	324	10年国債	0.8000	80,000	83,643	2022/06/20
	56	20年国債	2.0000	12,000	13,275	2022/06/20
	57	20年国債	1.9000	24,000	26,429	2022/06/20
	325	10年国債	0.8000	137,000	143,515	2022/09/20
	58	20年国債	1.9000	35,000	38,731	2022/09/20
	326	10年国債	0.7000	20,000	20,879	2022/12/20
	59	20年国債	1.7000	3,000	3,301	2022/12/20
	328	10年国債	0.6000	60,000	62,406	2023/03/20
	61	20年国債	1.0000	40,000	42,559	2023/03/20
	329	10年国債	0.8000	50,000	52,700	2023/06/20
	62	20年国債	0.8000	16,000	16,869	2023/06/20
	63	20年国債	1.8000	30,000	33,450	2023/06/20
	330	10年国債	0.8000	81,000	85,531	2023/09/20
	331	10年国債	0.6000	103,000	107,459	2023/09/20
	64	20年国債	1.9000	35,000	39,404	2023/09/20
	332	10年国債	0.6000	35,000	36,563	2023/12/20
	65	20年国債	1.9000	42,000	47,480	2023/12/20
	66	20年国債	1.8000	30,000	33,717	2023/12/20
	333	10年国債	0.6000	53,000	55,439	2024/03/20
	67	20年国債	1.9000	19,000	21,558	2024/03/20
	68	20年国債	2.2000	25,000	28,877	2024/03/20
	69	20年国債	2.1000	12,000	13,779	2024/03/20
	334	10年国債	0.6000	156,000	163,447	2024/06/20
	70	20年国債	2.4000	18,000	21,143	2024/06/20
	71	20年国債	2.2000	17,000	19,728	2024/06/20
	335	10年国債	0.5000	140,000	145,684	2024/09/20
	72	20年国債	2.1000	53,000	61,357	2024/09/20
	336	10年国債	0.5000	48,000	49,978	2024/12/20
	337	10年国債	0.3000	14,000	14,365	2024/12/20
	73	20年国債	2.0000	30,000	34,626	2024/12/20
	74	20年国債	2.1000	22,000	25,558	2024/12/20
	338	10年国債	0.4000	152,000	157,160	2025/03/20
	75	20年国債	2.1000	14,000	16,326	2025/03/20
	76	20年国債	1.9000	25,000	28,764	2025/03/20
	339	10年国債	0.4000	45,000	46,539	2025/06/20
	78	20年国債	1.9000	17,000	19,627	2025/06/20
	79	20年国債	2.0000	14,000	16,276	2025/06/20
	80	20年国債	2.1000	20,000	23,412	2025/06/20
	340	10年国債	0.4000	55,000	56,893	2025/09/20
	81	20年国債	2.0000	39,000	45,502	2025/09/20
	82	20年国債	2.1000	28,000	32,900	2025/09/20
	341	10年国債	0.3000	48,000	49,249	2025/12/20
	83	20年国債	2.1000	25,000	29,481	2025/12/20
	84	20年国債	2.0000	27,000	31,609	2025/12/20
	342	10年国債	0.1000	60,000	60,500	2026/03/20
	85	20年国債	2.1000	31,000	36,701	2026/03/20
	86	20年国債	2.3000	6,000	7,208	2026/03/20
	87	20年国債	2.2000	20,000	23,854	2026/03/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

2017年6月5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		
	343 10年国債	0.1000	152,000	153,234	2026/06/20	
	88 20年国債	2.3000	33,000	39,821	2026/06/20	
	89 20年国債	2.2000	15,000	17,965	2026/06/20	
	344 10年国債	0.1000	58,000	58,429	2026/09/20	
	90 20年国債	2.2000	37,000	44,477	2026/09/20	
	91 20年国債	2.3000	12,000	14,536	2026/09/20	
	345 10年国債	0.1000	155,000	156,105	2026/12/20	
	92 20年国債	2.1000	45,000	53,883	2026/12/20	
	346 10年国債	0.1000	170,000	171,076	2027/03/20	
	93 20年国債	2.0000	18,000	21,448	2027/03/20	
	94 20年国債	2.1000	45,000	54,060	2027/03/20	
	95 20年国債	2.3000	30,000	36,776	2027/06/20	
	96 20年国債	2.1000	23,000	27,735	2027/06/20	
	97 20年国債	2.2000	25,000	30,485	2027/09/20	
	98 20年国債	2.1000	34,000	41,112	2027/09/20	
	99 20年国債	2.1000	53,000	64,286	2027/12/20	
	100 20年国債	2.2000	35,000	42,955	2028/03/20	
	101 20年国債	2.4000	18,000	22,476	2028/03/20	
	102 20年国債	2.4000	10,000	12,531	2028/06/20	
	103 20年国債	2.3000	21,000	26,085	2028/06/20	
	104 20年国債	2.1000	34,000	41,490	2028/06/20	
	105 20年国債	2.1000	38,000	46,508	2028/09/20	
	106 20年国債	2.2000	16,000	19,761	2028/09/20	
	107 20年国債	2.1000	20,000	24,548	2028/12/20	
	108 20年国債	1.9000	48,000	57,821	2028/12/20	
	109 20年国債	1.9000	35,000	42,263	2029/03/20	
	110 20年国債	2.1000	27,000	33,230	2029/03/20	
	111 20年国債	2.2000	35,000	43,611	2029/06/20	
	112 20年国債	2.1000	29,000	35,791	2029/06/20	
	113 20年国債	2.1000	74,000	91,575	2029/09/20	
	114 20年国債	2.1000	45,000	55,797	2029/12/20	
	115 20年国債	2.2000	22,000	27,549	2029/12/20	
	2 30年国債	2.4000	9,000	11,524	2030/02/20	
	116 20年国債	2.2000	27,000	33,878	2030/03/20	
	117 20年国債	2.1000	37,000	45,963	2030/03/20	
	3 30年国債	2.3000	4,000	5,082	2030/05/20	
	118 20年国債	2.0000	13,000	16,023	2030/06/20	
	119 20年国債	1.8000	13,000	15,692	2030/06/20	
	120 20年国債	1.6000	60,000	70,851	2030/06/20	
	121 20年国債	1.9000	56,000	68,410	2030/09/20	
	122 20年国債	1.8000	10,000	12,086	2030/09/20	
	4 30年国債	2.9000	8,000	10,844	2030/11/20	
	123 20年国債	2.1000	42,000	52,517	2030/12/20	
	124 20年国債	2.0000	35,000	43,303	2030/12/20	
	125 20年国債	2.2000	25,000	31,685	2031/03/20	
	126 20年国債	2.0000	21,000	26,035	2031/03/20	
	127 20年国債	1.9000	23,000	28,206	2031/03/20	
	5 30年国債	2.2000	8,000	10,150	2031/05/20	
	128 20年国債	1.9000	32,000	39,292	2031/06/20	
	129 20年国債	1.8000	34,000	41,285	2031/06/20	
	130 20年国債	1.8000	28,000	34,057	2031/09/20	
	131 20年国債	1.7000	37,000	44,492	2031/09/20	
	6 30年国債	2.4000	9,000	11,723	2031/11/20	
	132 20年国債	1.7000	25,000	30,084	2031/12/20	

2017年6月5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		
	133 20年国債	1.8000	50,000	60,871	2031/12/20	
	134 20年国債	1.8000	25,000	30,480	2032/03/20	
	135 20年国債	1.7000	20,000	24,082	2032/03/20	
	136 20年国債	1.6000	40,000	47,596	2032/03/20	
	7 30年国債	2.3000	12,000	15,511	2032/05/20	
	137 20年国債	1.7000	18,000	21,703	2032/06/20	
	138 20年国債	1.5000	24,000	28,224	2032/06/20	
	139 20年国債	1.6000	32,000	38,121	2032/06/20	
	140 20年国債	1.7000	60,000	72,384	2032/09/20	
	8 30年国債	1.8000	5,000	6,108	2032/11/22	
	9 30年国債	1.4000	11,000	12,786	2032/12/20	
	141 20年国債	1.7000	48,000	57,975	2032/12/20	
	142 20年国債	1.8000	30,000	36,680	2032/12/20	
	10 30年国債	1.1000	15,000	16,745	2033/03/20	
	143 20年国債	1.6000	48,000	57,274	2033/03/20	
	144 20年国債	1.5000	24,000	28,254	2033/03/20	
	11 30年国債	1.7000	9,000	10,886	2033/06/20	
	145 20年国債	1.7000	78,000	94,345	2033/06/20	
	12 30年国債	2.1000	11,000	13,998	2033/09/20	
	146 20年国債	1.7000	58,000	70,173	2033/09/20	
	13 30年国債	2.0000	11,000	13,837	2033/12/20	
	147 20年国債	1.6000	74,000	88,390	2033/12/20	
	14 30年国債	2.4000	22,000	29,126	2034/03/20	
	148 20年国債	1.5000	59,000	69,535	2034/03/20	
	15 30年国債	2.5000	21,000	28,168	2034/06/20	
	149 20年国債	1.5000	72,000	84,834	2034/06/20	
	16 30年国債	2.5000	26,000	34,941	2034/09/20	
	150 20年国債	1.4000	61,000	70,863	2034/09/20	
	17 30年国債	2.4000	17,000	22,590	2034/12/20	
	151 20年国債	1.2000	69,000	77,790	2034/12/20	
	18 30年国債	2.3000	20,000	26,265	2035/03/20	
	152 20年国債	1.2000	69,000	77,712	2035/03/20	
	19 30年国債	2.3000	15,000	19,727	2035/06/20	
	153 20年国債	1.3000	72,000	82,277	2035/06/20	
	20 30年国債	2.5000	16,000	21,633	2035/09/20	
	154 20年国債	1.2000	67,000	75,362	2035/09/20	
	21 30年国債	2.3000	16,000	21,100	2035/12/20	
	155 20年国債	1.0000	70,000	76,195	2035/12/20	
	22 30年国債	2.5000	17,000	23,035	2036/03/20	
	156 20年国債	0.4000	63,000	61,705	2036/03/20	
	23 30年国債	2.5000	16,000	21,712	2036/06/20	
	157 20年国債	0.2000	77,000	72,417	2036/06/20	
	24 30年国債	2.5000	15,000	20,366	2036/09/20	
	158 20年国債	0.5000	63,000	62,504	2036/09/20	
	25 30年国債	2.3000	17,000	22,486	2036/12/20	
	159 20年国債	0.6000	70,000	70,617	2036/12/20	
	26 30年国債	2.4000	32,000	42,984	2037/03/20	
	160 20年国債	0.7000	80,000	81,994	2037/03/20	
	27 30年国債	2.5000	32,000	43,707	2037/09/20	
	28 30年国債	2.5000	34,000	46,583	2038/03/20	
	29 30年国債	2.4000	43,000	58,270	2038/09/20	
	30 30年国債	2.3000	47,000	62,938	2039/03/20	
	31 30年国債	2.2000	38,000	50,248	2039/09/20	
	32 30年国債	2.3000	49,000	66,027	2040/03/20	

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

2017年6月5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		
	33 30年国債	2.0000	55,000	70,805	2040/09/20	
	34 30年国債	2.2000	50,000	66,720	2041/03/20	
	35 30年国債	2.0000	56,000	72,388	2041/09/20	
	36 30年国債	2.0000	59,000	76,408	2042/03/20	
	37 30年国債	1.9000	57,000	72,631	2042/09/20	
	38 30年国債	1.8000	39,000	48,849	2043/03/20	
	39 30年国債	1.9000	37,000	47,245	2043/06/20	
	40 30年国債	1.8000	29,000	36,364	2043/09/20	
	41 30年国債	1.7000	34,000	41,843	2043/12/20	
	42 30年国債	1.7000	33,000	40,626	2044/03/20	
	43 30年国債	1.7000	37,000	45,566	2044/06/20	
	44 30年国債	1.7000	35,000	43,117	2044/09/20	
	45 30年国債	1.5000	40,000	47,332	2044/12/20	
	46 30年国債	1.5000	48,000	56,799	2045/03/20	
	47 30年国債	1.6000	44,000	53,218	2045/06/20	
	48 30年国債	1.4000	45,000	52,191	2045/09/20	
	49 30年国債	1.4000	45,000	52,182	2045/12/20	
	50 30年国債	0.8000	44,000	44,206	2046/03/20	
	51 30年国債	0.3000	45,000	39,327	2046/06/20	
	52 30年国債	0.5000	47,000	43,447	2046/09/20	
	53 30年国債	0.6000	40,000	37,952	2046/12/20	
	54 30年国債	0.8000	45,000	45,000	2047/03/20	
	1 40年国債	2.4000	60,000	85,723	2048/03/20	
	2 40年国債	2.2000	23,000	31,722	2049/03/20	
	3 40年国債	2.2000	19,000	26,318	2050/03/20	
	4 40年国債	2.2000	30,000	41,724	2051/03/20	
	5 40年国債	2.0000	35,000	46,682	2052/03/20	
	6 40年国債	1.9000	28,000	36,568	2053/03/20	
	7 40年国債	1.7000	31,000	38,599	2054/03/20	
	8 40年国債	1.4000	23,000	26,428	2055/03/20	
	9 40年国債	0.4000	20,000	16,462	2056/03/20	
	10 40年国債	0.9000	4,000	3,925	2057/03/20	
種別 小計	銘柄数	246銘柄				
小計	金額		10,923,000	12,142,154		
地方債証券	20-6 北海道公債	1.7200	100,000	102,107	2018/08/29	
	21-2 埼玉県公債	1.5700	100,000	103,060	2019/05/27	
	76 共同発行地方	1.4000	100,000	102,936	2019/07/25	
	21-6 大阪市公債	1.5700	100,000	103,831	2019/11/25	
	21-35 兵庫県公債	1.4600	100,000	103,770	2020/01/22	
	116 共同発行地方	0.8000	100,000	104,081	2022/11/25	
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	103,689	2022/12/22	
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	103,976	2023/01/31	
	25-6 大阪市公債	0.6940	100,000	104,066	2023/11/22	
	3 兵庫県公債12年	0.5600	100,000	103,379	2025/04/16	
	751 東京都公債	0.3700	100,000	102,035	2025/12/19	
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	99,427	2026/03/19	
種別 小計	銘柄数	12銘柄				
小計	金額		1,200,000	1,236,362		
特殊債券 (除く金融債券)	2 政保地方公営機	1.6000	100,000	102,321	2018/11/16	
	5 日本政策投資CO	1.7450	100,000	103,102	2019/03/20	
	98 政保道路機構	1.3000	100,000	103,431	2020/01/31	
	14 政保地方公共6	0.1990	100,000	100,573	2020/06/18	
	122 政保道路機構	0.9000	100,000	103,103	2020/11/30	
	36 地方公共団体	0.8920	100,000	104,089	2022/05/27	

2017年6月5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		
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	103,585	2023/05/31	
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	103,035	2024/10/28	
	261 政保道路機構	0.3810	100,000	102,561	2025/11/28	
種別 小計	銘柄数	9銘柄				
小計	金額		900,000	925,804		
金融債券	い789 利付商工債	0.0500	100,000	100,047	2021/02/26	
種別 小計	銘柄数	1銘柄				
小計	金額		100,000	100,047		
普通社債券	35 みずほBK	0.2850	100,000	100,457	2019/01/25	
	25 東日本高速道	0.2990	100,000	100,475	2019/03/20	
	27 東日本高速道	0.2480	100,000	100,428	2019/06/20	
	1 明治安田2014基	0.5100	100,000	100,457	2019/08/07	
	164 オリックス	1.1460	100,000	102,269	2019/08/07	
	62 トヨタファイナンス	0.2030	100,000	100,378	2019/12/20	
	70 東日本旅客鉄道	1.1930	100,000	103,712	2020/09/29	
	44 野村ホールディング	0.7230	100,000	101,764	2021/02/25	
	33 中日本高速道	1.0840	100,000	104,287	2021/09/17	
	32 東日本旅客鉄道	2.2600	100,000	114,252	2024/03/19	
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,113	2026/08/21	
種別 小計	銘柄数	11銘柄				
小計	金額		1,100,000	1,127,596		
合計	銘柄数	279銘柄				
合計	金額		14,223,000	15,531,965		

(注) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ・ライフ・バランス50）が投資対象としている「外国株式インデックスマザーファンド」の決算日（2016年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017年6月5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24～35ページに併せて掲載いたします。

■外国株式インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2016年6月7日から2017年6月5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	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		千株	千円	円		千株	千円	円
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR (イスラエル)	20.9	100,444	4,805	SYNGENTA AG-REG (スイス)	2.162	109,575	50,682	ENBRIDGE INC (カナダ)	17.7	81,735	4,617	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD (イスラエル)	20.6	96,915	4,704
APPLE INC (アメリカ)	5.2	63,944	12,297	APPLE INC (アメリカ)	6.1	84,376	13,832	APPLE INC (アメリカ)	5.2	63,944	12,297	ENBRIDGE INC (カナダ)	15.74	73,158	4,647
FACEBOOK INC-A (アメリカ)	4.5	62,160	13,813	ENBRIDGE INC (カナダ)	15.74	73,158	4,647	MICROSOFT CORP (アメリカ)	0.72	61,100	84,861	MICROSOFT CORP (アメリカ)	6.9	49,866	7,227
AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.72	61,100	84,861	MICROSOFT CORP (アメリカ)	6.9	49,866	7,227	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	6.4	59,028	9,223	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	3.8	36,056	9,488
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	6.4	59,028	9,223	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	3.8	36,056	9,488	GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)	8.35	53,125	6,362	GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)	9.6	34,386	3,581
MICROSOFT CORP (アメリカ)	8.35	53,125	6,362	GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)	9.6	34,386	3,581	EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	48.4	52,248	1,079	EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	3.3	32,723	9,916
UNICREDIT SPA (イタリア)	48.4	52,248	1,079	EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	3.3	32,723	9,916	JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	0.57	47,729	83,735	JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	2.45	32,058	13,085
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.57	47,729	83,735	JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	2.45	32,058	13,085	NESTLE SA-REG (スイス)	3.65	46,450	12,726	NESTLE SA-REG (スイス)	3.8	30,745	8,090
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	3.65	46,450	12,726	NESTLE SA-REG (スイス)	3.8	30,745	8,090								

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2017年6月5日現在における外国株式インデックスマザーファンド（39,805,675千円）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	株数	2017年6月5日現在		業種等
		評価額	業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千円		
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	27	209	23,164	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	21	290	32,045	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	13.5	200	22,163	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	188	515	56,915	金融
ABBOTT LABORATORIES	394.16	1,832	202,510	ヘルスケア
ARCONIC INC	103.33	290	32,150	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	37.5	306	33,917	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	101	631	69,802	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	69.5	525	58,022	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	71.79	622	68,747	情報技術
QORVO INC	29	228	25,297	情報技術
AFLAC INC	93	706	78,022	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	27.5	251	27,741	一般消費財・サービス
ADOBE SYSTEMS INC	113.5	1,628	179,932	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	55	145	16,043	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	25	135	14,996	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	68	114	12,607	金融
GARMIN LTD	26	137	15,211	一般消費財・サービス
AETNA INC	79.29	1,171	129,422	ヘルスケア
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	46.5	682	75,417	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	165	2,211	244,348	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	37.51	222	24,547	情報技術
WR BERKLEY CORP	21	145	16,033	金融
AUTOZONE INC	6.7	416	46,023	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	52.71	423	46,841	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	209	606	67,037	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	26.5	236	26,123	公益事業
CELANESE CORP-SERIES A	33	290	32,100	素材
DR HORTON INC	79.66	269	29,740	一般消費財・サービス

銘柄	株数	2017年6月5日現在		業種等
		評価額	業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千円		
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	21	75	8,369	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	52	335	37,029	ヘルスケア
AUTODESK INC	45.5	513	56,763	情報技術
MOODY'S CORP	38.5	457	50,544	金融
DEVON ENERGY CORP	109	361	39,899	エネルギー
ALBEMARLE CORP	26	296	32,775	素材
ATMOS ENERGY CORP	23	195	21,570	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	50	209	23,108	公益事業
CITIGROUP INC	646.23	3,949	436,337	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	103	1,040	114,919	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	111	806	89,125	公益事業
ALLEGHANY CORP	3.5	209	23,105	金融
DOMINO'S PIZZA INC	11	239	26,501	一般消費財・サービス
HESS CORP	65	297	32,856	エネルギー
DAVITA INC	38	252	27,891	ヘルスケア
DANAHER CORP	142	1,233	136,248	ヘルスケア
FORTIVE CORP	72	456	50,444	資本財・サービス
AVNET INC	28	103	11,446	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	135	814	89,974	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	40	80	8,887	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	40.28	75	8,331	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	129	544	60,177	生活必需品
BUNGE LTD	31	248	27,504	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	82.25	653	72,220	情報技術
APPLE INC	1,212	18,840	2,081,691	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	91	536	59,231	金融
BOEING CO/THE	132.5	2,520	278,495	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	34.65	245	27,074	金融
BECTON DICKINSON AND CO	48.87	943	104,245	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2017年6月5日現在			業種等
	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	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	40	89	9,922	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	33	184	20,400	情報技術
CDK GLOBAL INC	29	181	20,064	情報技術
NISOURCE INC	73	192	21,253	公益事業
CH.ROBINSON WORLDWIDE INC	33.5	226	25,028	資本財・サービス
CR BARD INC	16.8	526	58,166	ヘルスケア
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	242.71	1,153	127,407	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	927.04	4,305	475,678	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	278.5	4,631	511,698	金融
ANSYS INC	19	246	27,183	情報技術
H&R BLOCK INC	51	137	15,152	一般消費財・サービス
BB&T CORP	183.5	773	85,479	金融
BAKER HUGHES INC	91.73	504	55,693	エネルギー
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	380.5	2,091	231,101	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	814.7	6,732	743,893	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	56	400	44,258	金融
CIGNA CORP	59	970	107,209	ヘルスケア
LKQ CORP	68	219	24,290	一般消費財・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	10	144	15,938	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	50	262	29,025	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	64	225	24,940	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	36.6	448	49,606	金融
DOLLAR GENERAL CORP	65	512	56,671	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	38	407	45,051	情報技術
CATERPILLAR INC	132	1,398	154,524	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	64	305	33,794	公益事業
MOISAIC CO/THE	75.5	169	18,769	素材
DELTA AIR LINES INC	44	225	24,886	資本財・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	41	368	40,766	生活必需品
CORNING INC	216	641	70,857	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,141	3,648	403,168	情報技術
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	197	1,586	175,242	素材
MORGAN STANLEY	318	1,352	149,397	金融
WABCO HOLDINGS INC	12.5	156	17,264	資本財・サービス
DOW CHEMICAL CO/THE	257	1,620	179,036	素材
MSCI INC	20	208	23,083	金融
MIDDLEBY CORP	13	171	18,974	資本財・サービス
COTY INC-CL A	111.39	212	23,494	生活必需品
BROADCOM LTD	91.52	2,329	257,381	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	10.5	134	14,808	ヘルスケア
DICK'S SPORTING GOODS INC	20	82	9,062	一般消費財・サービス
ACUITY BRANDS INC	10	167	18,534	資本財・サービス
ARAMARK	53.5	207	22,929	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	49	161	17,866	素材
DTE ENERGY COMPANY	41.5	460	50,865	公益事業
CENTENE CORP	40	300	33,230	ヘルスケア
CBOE HOLDINGS INC	24	208	23,004	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	116	395	43,743	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	40.5	232	25,663	金融
GARTNER INC	19	229	25,374	情報技術
SPLUNK INC	32	200	22,101	情報技術
AGCO CORP	14.5	94	10,450	資本財・サービス
DOMINION ENERGY INC	143	1,161	128,296	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	93	476	52,682	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	34	191	21,131	資本財・サービス
DEERE & CO	60.5	755	83,497	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	36	332	36,749	情報技術
TIME WARNER INC	176.33	1,748	193,229	一般消費財・サービス
VMWARE INC-CLASS A	14.5	138	15,277	情報技術
NASDAQ INC	27	182	20,136	金融
VAIL RESORTS INC	9.5	204	22,605	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	34	184	20,357	金融
TARGA RESOURCES CORP	41.5	188	20,854	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	15	189	20,895	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	70	584	64,604	公益事業
MEDNAX INC	22	122	13,481	ヘルスケア

銘柄	2017年6月5日現在			業種等
	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	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	24	247	27,299	一般消費財・サービス
TELEFLEX INC	10	207	22,873	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	21	180	19,949	資本財・サービス
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	17.5	137	15,143	資本財・サービス
IDEX CORP	18	198	21,896	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	191.5	1,476	163,155	生活必需品
ROLLINS INC	22	94	10,466	資本財・サービス
AMETEK INC	52.25	323	35,712	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	58	304	33,689	生活必需品
LYONDELLBASELL INDU-CL A	80	640	70,748	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	99.5	1,800	198,953	生活必需品
SCANA CORP	31	212	23,507	公益事業
AFFILIATED MANAGERS GROUP	12	193	21,346	金融
WR GRACE & CO	16	116	12,830	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6.5	310	34,334	一般消費財・サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP	76	186	20,564	金融
UGI CORP	39	201	22,269	公益事業
CUMMINS INC	37	585	64,649	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	136	811	89,633	情報技術
SABRE CORP	46	104	11,537	情報技術
CDW CORP/DE	32.5	199	21,990	情報技術
SIGNATURE BANK	13	188	20,815	金融
COSTAR GROUP INC	7.5	196	21,730	情報技術
SVB FINANCIAL GROUP	12	203	22,443	金融
AMERCO	1.7	60	6,695	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	9	252	27,880	情報技術
HANESBRANDS INC	85	181	20,013	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	18	189	20,928	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	45.66	307	34,008	一般消費財・サービス
DEXCOM INC	19	128	14,208	ヘルスケア
DIAMONDBACK ENERGY INC	20.5	188	20,802	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	22.5	148	16,395	ヘルスケア
ALLEN TECHNOLOGY INC	17	254	28,118	ヘルスケア
TRANSIDGM GROUP INC	12	326	36,020	資本財・サービス
NIelsen HOLDINGS PLC	80	312	34,517	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	428.81	812	89,783	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	68	566	62,608	ヘルスケア
CABOT OIL & GAS CORP	105.5	227	25,166	エネルギー
T-MOBILE US INC	64.5	440	48,688	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	25	112	12,446	情報技術
COCA-COLA CO/THE	934.5	4,288	473,827	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	40	218	24,192	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	25	118	13,115	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	82	350	38,741	金融
CSX CORP	214	1,167	128,959	資本財・サービス
FLUOR CORP	33	150	16,611	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	23.5	332	36,761	ヘルスケア
EXPEDIA INC	28.75	420	46,495	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	20	230	25,445	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	91.9	9,251	1,022,236	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	50	150	16,650	エネルギー
FLOWSERVE CORP	29	140	15,569	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49	576	63,647	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	943.05	7,497	828,370	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	31	119	13,252	情報技術
AES CORP	156	185	20,528	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	18	303	33,499	資本財・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	9	229	25,410	金融
EOG RESOURCES INC	132.5	1,188	131,290	エネルギー
EQT CORP	40.5	221	24,517	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	39	189	20,912	情報技術
AMERISOURCEBERGEN CORP	38	355	39,290	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	72.9	443	48,980	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	853.23	968	107,000	一般消費財・サービス
MACY'S INC	68.98	164	18,147	一般消費財・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	34.4	91	10,068	一般消費財・サービス

銘柄	2017年6月5日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円		
LIBERTY GLOBAL PLC-A	56.87	180	19,950	一般消費財・サービス	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	51.2	132	14,623	一般消費財・サービス	
MOBILEYE NV	39	240	26,621	情報技術	
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	3	32	3,576	ヘルスケア	
AERCAP HOLDINGS NV	38	172	19,070	資本財・サービス	
FORTINET INC	35	136	15,101	情報技術	
MARKET CORP	3.2	316	34,981	金融	
NEXTERA ENERGY INC	107	1,526	168,717	公益事業	
FREEMPORT-MCMORAN INC	297.08	335	37,058	素材	
US BANCORP	387.5	1,987	219,640	金融	
UNITED RENTALS INC	19	206	22,775	資本財・サービス	
F5 NETWORKS INC	14.5	187	20,716	情報技術	
FASTENAL CO	65	287	31,794	資本財・サービス	
FISERV INC	49.5	622	68,754	情報技術	
GENERAL ELECTRIC CO	2,015	5,617	620,712	資本財・サービス	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	36.5	186	20,632	一般消費財・サービス	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	61.5	210	23,286	一般消費財・サービス	
GENERAL MOTORS CO	311	1,071	118,378	一般消費財・サービス	
TRIPADVISOR INC	27.5	107	11,889	一般消費財・サービス	
GENERAL DYNAMICS CORP	59	1,201	132,790	資本財・サービス	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	81.5	1,738	192,084	金融	
ALPHABET INC-CL A	67.4	6,713	741,813	情報技術	
ALPHABET INC-CL C	70.57	6,884	760,702	情報技術	
GENERAL MILLS INC	136	782	86,478	生活必需品	
FIRSTENERGY CORP	99.68	293	32,435	公益事業	
GENUINE PARTS CO	35	329	36,459	一般消費財・サービス	
IHS MARKIT LTD	82.34	387	42,813	資本財・サービス	
FIFTH THIRD BANCORP	175	413	45,709	金融	
HARRIS CORP	27.5	313	34,583	情報技術	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	30	148	16,414	資本財・サービス	
HALLIBURTON CO	198.5	899	99,353	エネルギー	
HOME DEPOT INC	275.5	4,279	472,885	一般消費財・サービス	
ASSURANT INC	14	140	15,493	金融	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	246	309	34,193	金融	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	11	213	23,553	資本財・サービス	
HERSHEY CO/THE	33	382	42,251	生活必需品	
HARLEY-DAVIDSON INC	40	212	23,529	一般消費財・サービス	
HUMANA INC	34	796	87,984	ヘルスケア	
NXP SEMICONDUCTORS NV	76	829	91,655	情報技術	
HELMERICH & PAYNE	26	138	15,257	エネルギー	
HENRY SCHEIN INC	18	335	37,105	ヘルスケア	
HP INC	389	738	81,577	情報技術	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	377	655	72,479	情報技術	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	45	192	21,280	一般消費財・サービス	
HOLLYFRONTIER CORP	39	93	10,359	エネルギー	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	21	90	9,954	一般消費財・サービス	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	28	276	30,562	金融	
KRAFT HEINZ CO/THE	138.53	1,295	143,174	生活必需品	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	205.5	3,124	345,240	情報技術	
INTERNATIONAL PAPER CO	88	478	52,884	素材	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	36	228	25,258	資本財・サービス	
ZOETIS INC	107	668	73,890	ヘルスケア	
INGERSOLL-RAND PLC	57.79	517	57,134	資本財・サービス	
CHENIERE ENERGY INC	47	228	25,290	エネルギー	
ALLEGION PLC	22	176	19,460	資本財・サービス	
LEGGOTT & PLATT INC	31	162	17,968	一般消費財・サービス	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	137.23	419	46,397	一般消費財・サービス	
WASTE CONNECTIONS INC	41.05	397	43,959	資本財・サービス	
JUNIPER NETWORKS INC	76	228	25,216	情報技術	
JM SMUCKER CO/THE	27.2	354	39,222	生活必需品	
JOHNSON & JOHNSON	619.5	8,058	890,378	ヘルスケア	
ABBVIE INC	371.79	2,500	276,256	ヘルスケア	
HOLOGIC INC	57.5	258	28,608	ヘルスケア	
KIMBERLY-CLARK CORP	81.5	1,064	117,640	生活必需品	
KROGER CO	205	617	68,245	生活必需品	
KLA-TENCOR CORP	36.5	386	42,700	情報技術	

銘柄	2017年6月5日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円		
LOCKHEED MARTIN CORP	60	1,690	186,789	資本財・サービス	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	21	311	34,421	情報技術	
L BRANDS INC	56	293	32,453	一般消費財・サービス	
LOWE'S COS INC	197.5	1,584	175,054	一般消費財・サービス	
ELI LILLY & CO	224	1,794	198,319	ヘルスケア	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	69	427	47,199	電気通信サービス	
LAM RESEARCH CORP	37	587	64,894	情報技術	
RANGE RESOURCES CORP	43	95	10,566	エネルギー	
JONES LANG LASALLE INC	10	117	12,957	不動産	
LOEWS CORP	65	307	33,970	金融	
LINCOLN NATIONAL CORP	51.49	338	37,423	金融	
MCDONALD'S CORP	188.5	2,897	320,199	一般消費財・サービス	
3M CO	137	2,831	312,884	資本財・サービス	
FACEBOOK INC-A	532.5	8,179	903,778	情報技術	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	49.54	338	37,357	情報技術	
MANPOWERGROUP INC	15	156	17,299	資本財・サービス	
S&P GLOBAL INC	59.5	857	94,773	金融	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	14	317	35,044	素材	
CONCHO RESOURCES INC	32.5	404	44,674	エネルギー	
ENVISION HEALTHCARE CORP	26.36	146	16,231	ヘルスケア	
FIRST DATA CORP- CLASS A	72	129	14,303	情報技術	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	38	122	13,490	電気通信サービス	
PHILLIPS 66	106.5	813	89,865	エネルギー	
MURPHY OIL CORP	36	86	9,570	エネルギー	
TECHNIPFMC PLC	100	290	32,042	エネルギー	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	107.5	349	38,626	一般消費財・サービス	
MATTEL INC	78	175	19,442	一般消費財・サービス	
DXC TECHNOLOGY CO	65.38	507	56,049	情報技術	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	26.5	279	30,866	生活必需品	
MYLAN NV	104.5	408	45,122	ヘルスケア	
METLIFE INC	213.5	1,098	121,344	金融	
MARVEL TECHNOLOGY GROUP LTD	105	184	20,406	情報技術	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	33.78	292	32,329	情報技術	
MONSANTO CO	100.56	1,184	130,908	素材	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	358	39,585	ヘルスケア	
ROCKWELL AUTOMATION INC	29.5	479	52,930	資本財・サービス	
MERCK & CO. INC.	629.71	4,122	455,518	ヘルスケア	
MASCO CORP	74	278	30,775	資本財・サービス	
M & T BANK CORP	31.69	499	55,179	金融	
MARSH & MCLENNAN COS	117.5	910	100,614	金融	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	75.22	827	91,471	一般消費財・サービス	
WORKDAY INC-CLASS A	27	281	31,147	情報技術	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	39.5	130	14,424	一般消費財・サービス	
VANTIV INC - CL A	35.5	220	24,318	情報技術	
NETAPP INC	61.5	242	26,779	情報技術	
NIKE INC -CL B	305.5	1,618	178,832	一般消費財・サービス	
NORFOLK SOUTHERN CORP	65.5	809	89,479	資本財・サービス	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	48.5	409	45,195	情報技術	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	30	219	24,306	金融	
ALLY FINANCIAL INC	102	192	21,311	金融	
NORTHROP GRUMMAN CORP	38.3	990	109,399	資本財・サービス	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	62	552	60,995	一般消費財・サービス	
NEWMONT MINING CORP	120	408	45,119	素材	
MCKESSON CORP	51.5	853	94,287	ヘルスケア	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	64	309	34,239	情報技術	
XYLEM INC	42	222	24,595	資本財・サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	352.5	4,293	474,344	生活必需品	
NUCOR CORP	71.5	419	46,373	素材	
WESTERN UNION CO	113.46	218	24,169	情報技術	
NEWELL BRANDS INC	100.92	538	59,488	一般消費財・サービス	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	174	1,056	116,697	エネルギー	
LIBERTY BROADBAND-C	23.5	215	23,841	一般消費財・サービス	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	6	82	9,088	生活必需品	
PAYCHEX INC	75.5	447	49,443	情報技術	
PATTERSON COS INC	19	89	9,864	ヘルスケア	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21.2	521	57,604	一般消費財・サービス	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2017年6月5日現在			業種等
	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	
ALTRIA GROUP INC	443.5	3,331	368,105	生活必需品
P G & E CORP	115	791	87,483	公益事業
PFIZER INC	1,376.63	4,479	494,945	ヘルスケア
ALKERMES PLC	36	213	23,619	ヘルスケア
XCEL ENERGY INC	115	555	61,397	公益事業
STRYKER CORP	76	1,098	121,323	ヘルスケア
PARKER HANNIFIN CORP	30.5	488	53,999	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	39	643	71,048	エネルギー
POLARIS INDUSTRIES INC	14	120	13,262	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	581.17	5,148	568,867	生活必需品
EXELON CORP	212.22	776	85,820	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	51	519	57,381	ヘルスケア
NVR INC	0.9	209	23,188	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	282.5	1,250	138,150	エネルギー
PEPSICO INC	326	3,836	423,844	生活必需品
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	99	1,053	116,407	金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	40.5	319	35,351	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	142	1,785	197,280	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	19.5	128	14,204	金融
PENTAIR PLC	40.05	265	29,294	資本財・サービス
QUALCOMM INC	333.5	1,953	215,858	情報技術
INVESCO LTD	91.5	301	33,291	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	17	234	25,883	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	66	422	46,641	金融
RAYTHEON COMPANY	67	1,093	120,873	資本財・サービス
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	18	118	13,114	一般消費財・サービス
RED HAT INC	42	384	42,479	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	17.7	850	93,956	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	53.5	346	38,233	資本財・サービス
PRICELINE GROUP INC/THE	11.2	2,123	234,622	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	90	573	63,383	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	21	218	24,177	素材
RESMED INC	32.5	233	25,840	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	31	340	37,656	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	28	132	14,645	資本財・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	194.78	1,319	145,763	生活必需品
RALPH LAUREN CORP	13	89	9,935	一般消費財・サービス
AUTONATION INC	17	67	7,487	一般消費財・サービス
ROCKWELL COLLINS INC	36.13	391	43,205	資本財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	274.35	371	41,043	金融
CHEVRON CORP	429.68	4,430	489,518	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	75	615	67,959	公益事業
TESLA INC	29	985	108,895	一般消費財・サービス
SYMANTEC CORP	139	418	46,197	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	34.72	483	53,419	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	34	257	28,482	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	49.05	1,731	191,325	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	71	251	27,825	不動産
TWITTER INC	130	238	26,299	情報技術
NAVIENT CORP	71	100	11,155	金融
SOUTHERN CO/THE	223.5	1,140	125,966	公益事業
SYSCO CORP	118.5	660	72,967	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	65.23	816	90,198	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	32	164	18,180	金融
STERICYCLE INC	19.5	160	17,736	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	57	195	21,639	素材
SCHLUMBERGER LTD	316.52	2,182	241,168	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	39	158	17,538	資本財・サービス
AT&T INC	1,394.91	5,422	599,078	電気通信・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	34	205	22,675	資本財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	17.8	614	67,930	素材
SEMPRA ENERGY	54	634	70,105	公益事業
TIFFANY & CO	28	251	27,840	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	65	280	31,039	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	227.5	1,857	205,189	情報技術
SALESFORCE.COM INC	147	1,335	147,575	情報技術

銘柄	2017年6月5日現在			業種等
	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	
SIGNET JEWELERS LTD	13	68	7,614	一般消費財・サービス
WESTROCK CO	59.3	326	36,101	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	215.84	911	100,758	資本財・サービス
TESORO CORP	26.5	223	24,744	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	1.86	2,068	228,528	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	190	241	26,703	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	119	627	69,291	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	177	2,161	238,826	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	157	1,690	186,774	資本財・サービス
UNUM GROUP	54	244	26,980	金融
SPRINT CORP	177.65	157	17,410	電気通信・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	34	66	7,393	エネルギー
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	34.94	307	33,945	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	45	159	17,571	金融
AMEREN CORPORATION	55	314	34,741	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	218.76	3,924	433,599	ヘルスケア
VERISIGN INC	22	203	22,496	情報技術
VALERO ENERGY CORP	103.92	645	71,303	エネルギー
UNION ALTA BEAUTY INC	13.1	408	45,082	一般消費財・サービス
ENF GROUP	57.38	250	27,629	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	20	228	25,224	ヘルスケア
ANTHEM INC	60.5	1,134	125,390	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	344.5	3,692	407,967	一般消費財・サービス
WELLS FARGO & CO	1,084.72	5,619	620,946	金融
FOOT LOCKER INC	32	185	20,521	一般消費財・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	100	742	82,038	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	187	540	59,670	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	31	172	19,047	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	17	322	35,667	一般消費財・サービス
WAL-MART STORES INC	351.5	2,798	309,222	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	46	570	62,993	ヘルスケア
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	221	104	11,549	エネルギー
WYNN RESORTS LTD	18	242	26,785	一般消費財・サービス
XEROX CORP	192.44	136	15,053	情報技術
WABTEC CORP	19	159	17,669	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	149	1,120	123,834	一般消費財・サービス
WATERS CORP	18	331	36,586	ヘルスケア
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	18	147	16,314	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	85.57	1,952	215,716	ヘルスケア
WHOLE FOODS MARKET INC	72	252	27,907	生活必需品
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	211	1,753	193,734	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	30.33	446	49,322	金融
WESTERN DIGITAL CORP	64.5	590	65,222	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	70.3	446	49,377	公益事業
WESTAR ENERGY INC	32	171	18,905	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	117.5	530	58,642	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	425.5	4,091	452,034	情報技術
PPL CORP	154	616	68,163	公益事業
PULTEGROUP INC	67	158	17,552	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	59.5	656	72,591	素材
NORTHERN TRUST CORP	49	433	47,919	金融
NVIDIA CORP	122	1,752	193,623	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	110.93	1,321	146,050	金融
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	95.5	231	25,535	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	47	194	21,535	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	65	376	41,575	生活必需品
NETFLIX INC	96.5	1,593	176,119	一般消費財・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	89.5	1,578	174,429	ヘルスケア
TORCHMARK CORP	26.75	204	22,601	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	34.5	324	35,820	金融
TEXTRON INC	63.5	303	33,501	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	239.5	668	73,909	一般消費財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-B	103	284	31,410	一般消費財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	83.37	113	12,509	一般消費財・サービス
OCG ENERGY CORP	47	168	18,585	公益事業
OMNICOM GROUP	55	468	51,726	一般消費財・サービス

銘柄	2017年6月5日現在			業種等
	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	
ORACLE CORP	700.83	3,199	353,566	情報技術
MASTERCARD INC - A	220	2,754	304,333	情報技術
ONEOK INC	49	242	26,826	エネルギー
CENTURYLINK INC	127.95	331	36,572	電気通信サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	23	531	58,754	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	79	584	64,583	一般消費財・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	11.5	273	30,220	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO-B	43.5	421	46,553	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	96	273	30,240	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	2,306.01	5,176	572,005	金融
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	38.5	349	38,591	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	127	14,077	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	178	1,397	154,368	金融
ANALOG DEVICES INC	82.99	671	74,190	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	175	190	21,075	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	60	226	25,025	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	234.22	1,504	166,246	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	127	635	70,245	エネルギー
SKYWORKS SOLUTIONS INC	41.5	449	49,714	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	38.5	436	48,230	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	45	138	15,328	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	25	106	11,780	ヘルスケア
AVERY DENNISON CORP	21	177	19,664	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	137.5	927	102,502	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	145.5	863	95,396	資本財・サービス
AON PLC	60	788	87,110	金融
AMGEN INC	169.5	2,697	298,056	ヘルスケア
CORE LABORATORIES N.V.	10	102	11,324	エネルギー
COACH INC	64	294	32,528	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	101.36	789	87,219	資本財・サービス
CELGENE CORP	176.5	2,095	231,541	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	40.2	742	82,069	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	245	1,146	126,687	情報技術
CIT GROUP INC	45	198	21,976	金融
CIMAREX ENERGY CO	21	219	24,265	エネルギー
CME GROUP INC	78	912	100,772	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	88.44	290	32,139	エネルギー
ECOLAB INC	59	792	87,568	素材
EQUIFAX INC	27.5	378	41,812	資本財・サービス
GAP INC/THE	58	130	14,457	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	300	1,962	216,781	ヘルスケア
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	40.98	380	42,036	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	68.5	233	25,816	生活必需品
STATE STREET CORP	87.93	727	80,326	金融
STAPLES INC	156	141	15,685	一般消費財・サービス
SUNTRUST BANKS INC	111.98	598	66,181	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	269	1,047	115,766	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	109.5	653	72,253	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	46	265	29,341	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	31	181	20,061	素材
CARDINAL HEALTH INC	71.5	541	59,874	ヘルスケア
FEDEX CORP	57	1,157	127,917	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	109.54	854	94,452	金融
FMC CORP	29.5	225	24,925	素材
FLEX LTD	122	214	23,751	情報技術
CERNER CORP	70	471	52,144	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	18	250	27,692	素材
CITRIX SYSTEMS INC	36.5	304	33,646	情報技術
INTEL CORP	1,080	3,922	433,403	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	88	221	24,511	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	86.5	429	47,442	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	72	1,033	114,245	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	385	211	23,332	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC	33.5	615	68,028	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	44	195	21,648	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	8.7	804	88,887	ヘルスケア

銘柄	2017年6月5日現在			業種等
	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	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	31	349	38,656	情報技術
SNAP-ON INC	13	211	23,376	資本財・サービス
CARMAX INC	42.5	270	29,865	一般消費財・サービス
COMERICA INC	40	274	30,305	金融
INGREDION INC	16	184	20,344	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	156.78	1,352	149,459	公益事業
TARGET CORP	119.5	663	73,306	一般消費財・サービス
DOVER CORP	35	291	32,155	資本財・サービス
VWV GRAINGER INC	13	224	24,808	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	29	154	17,046	資本財・サービス
CINTAS CORP	18.5	237	26,221	資本財・サービス
CA INC	71.05	228	25,270	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	95	376	41,555	生活必需品
CLOROX COMPANY	29.5	403	44,533	生活必需品
ENTERGY CORP	39.5	316	35,019	公益事業
MICROSOFT CORP	1,676.5	12,030	1,329,257	情報技術
INCYTE CORP	38.5	506	55,938	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	242.24	1,914	211,578	生活必需品
MEDTRONIC PLC	317.38	2,723	300,947	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	241	752	83,106	情報技術
BLACKROCK INC	27.5	1,140	126,008	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	91	262	29,037	公益事業
HASBRO INC	26	278	30,784	一般消費財・サービス
KEYLOGG CO	61	445	49,180	生活必需品
JELCO CORP	245	426	47,128	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	24	229	25,348	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	352.11	1,661	183,590	生活必需品
KOHL'S CORP	39	152	16,796	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	11	262	28,965	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	111	143	15,882	金融
APACHE CORP	87.6	411	45,481	エネルギー
CHUBB LTD	105.99	1,538	169,971	金融
ARROW ELECTRONICS INC	20	152	16,889	情報技術
ALLSTATE CORP	83.5	723	79,961	金融
EBAY INC	242	854	94,440	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC	249.5	1,335	147,539	情報技術
ESTMAN CHEMICAL CO	32.5	263	29,125	素材
XILINX INC	56	374	41,381	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	139.1	844	93,275	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP-A	53	350	38,696	一般消費財・サービス
YAHOO! INC	206	1,042	115,170	情報技術
ZIONS BANCORPORATION	48	192	21,267	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CLA	51.5	495	54,700	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	38	145	16,076	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	59	216	23,950	情報技術
LENNAR CORP-A	48	253	27,965	一般消費財・サービス
LEAR CORP	15.5	236	26,141	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	65	224	24,834	金融
PROGRESSIVE CORP	134	577	63,782	金融
PRAXAIR INC	64.5	881	97,363	素材
PACCAR INC	79.87	504	55,728	資本財・サービス
PVH CORP	19	201	22,244	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	49.8	1,278	141,219	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	20	339	37,535	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	331	2,137	236,146	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC	31.5	231	25,560	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	71.3	444	49,134	公益事業
INTUIT INC	56	799	88,362	情報技術
BORGWARNER INC	48	212	23,478	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	65	387	42,854	一般消費財・サービス
BALL CORP	75.84	313	34,657	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	310.47	856	94,678	ヘルスケア
BED BATH & BEYOND INC	36	126	14,001	一般消費財・サービス
XL GROUP LTD	61	264	29,170	金融
ELECTRONIC ARTS INC	68	778	86,042	情報技術
VULCAN MATERIALS CO	30.5	385	42,548	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2017年6月5日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	56.5	733	81,092	ヘルスケア	
VF CORP	77.5	421	46,531	一般消費財・サービス	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	87.71	537	59,406	一般消費財・サービス	
VIACOM INC-CLASS B	81.71	288	31,824	一般消費財・サービス	
MOHAWK INDUSTRIES INC	14	335	37,031	一般消費財・サービス	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	63	121	13,441	情報技術	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	22	223	24,679	ヘルスケア	
CARNIVAL CORP	80.5	527	58,231	一般消費財・サービス	
COMCAST CORP-CLASS A	1,085.4	4,557	503,568	一般消費財・サービス	
JARDINE STRATEGIC HDGS LTD	52	217	23,987	資本財・サービス	
JARDINE MATHESON HDGS LTD	48	312	34,578	資本財・サービス	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	265	201	22,223	不動産	
アメリカ・ドル 株数・金額 通貨計 銘柄数<比率>	70,523.74 598銘柄	488,872	54,015,536 <62.0%>		
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円		
IMPERIAL OIL LTD	6.7	253	20,756	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4.4	313	25,641	情報技術	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	46.96	134	11,035	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	50.87	417	34,184	一般消費財・サービス	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	107	294	24,119	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	31.5	297	24,359	金融	
BCE INC	34.3	209	17,147	電気通信サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	40	403	33,034	素材	
SUNCOR ENERGY INC	388.3	1,628	133,295	エネルギー	
METRO INC	55	252	20,699	生活必需品	
NATIONAL BANK OF CANADA	81	437	35,834	金融	
BANK OF NOVA SCOTIA	282	2,162	176,990	金融	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	91.5	966	79,109	金融	
TORONTO-DOMINION BANK	432	2,801	229,629	金融	
GREAT-WEST LIFE CO INC	67	227	18,596	金融	
ROYAL BANK OF CANADA	345.5	3,239	265,145	金融	
TOURMALINE OIL CORP	54	146	11,977	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	28	117	9,602	エネルギー	
TRANSCANADA CORP	201.5	1,276	104,465	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	89	389	31,921	エネルギー	
BOMBARDIER INC-B	454	116	9,512	資本財・サービス	
BARRICK GOLD CORP	273	597	48,868	素材	
CAE INC	58	127	10,410	資本財・サービス	
TOMSON REUTERS CORP	67.04	399	32,698	金融	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	193	427	35,006	素材	
EMPIRE CO LTD 'A'	39	82	6,780	生活必需品	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	14	83	6,863	素材	
VERESIN INC	80	148	12,159	エネルギー	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6.9	222	18,175	素材	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	97	90	7,439	金融	
LINAMAR CORP	11	68	5,604	一般消費財・サービス	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	54	128	10,537	エネルギー	
HYDRO ONE LTD	40	95	7,808	公益事業	
LOBLAW COMPANIES LTD	51.6	398	32,647	生活必需品	
EMERA INC	13	63	5,190	公益事業	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	28	114	9,398	公益事業	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	86	543	44,508	電気通信サービス	
AGNICO EAGLE MINES LTD	52	342	28,073	素材	
KINROSS GOLD CORP	295	171	14,076	素材	
BANK OF MONTREAL	150	1,369	112,056	金融	
POWER CORP OF CANADA	87	253	20,750	金融	
METHANEX CORP	22	122	10,037	素材	
SHOPIFY INC - CLASS A	17	224	18,353	情報技術	
TRISURA GROUP LTD-WI	1.22	2	220	金融	
CAMECO CORP	92	113	9,284	エネルギー	
TELUS CORP	54	247	20,247	電気通信サービス	
POWER FINANCIAL CORP	62	202	16,563	金融	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	134	316	25,884	素材	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	16	246	20,140	一般消費財・サービス	
TURKVOISE HILL RESOURCES LTD	208	71	5,822	素材	
AGRIUM INC	31	384	31,447	素材	

銘柄	2017年6月5日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千カナダ・ドル	千円		
CANADIAN NATURAL RESOURCES	258	1,004	82,230	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HDGS LTD	5.4	322	26,431	金融	
MAGNA INTERNATIONAL INC	89	557	45,601	一般消費財・サービス	
WESTON (GEORGE) LTD	11	136	11,141	生活必需品	
BLACKBERRY LTD	119	181	14,824	情報技術	
SUN LIFE FINANCIAL INC	142.5	630	51,646	金融	
ENBRIDGE INC	380	2,003	164,006	エネルギー	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	207.5	1,061	86,923	金融	
MANULIFE FINANCIAL CORP	458	1,079	88,395	金融	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	71	119	9,821	ヘルスケア	
GOLDCORP INC	199.59	362	29,683	素材	
ENCANA CORP	231	302	24,730	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	32	682	55,875	資本財・サービス	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	25	124	10,202	金融	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	52	208	17,024	一般消費財・サービス	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	179.5	1,900	155,530	資本財・サービス	
CGI GROUP INC - CLASS A	50	345	28,266	情報技術	
HUSKY ENERGY INC	75.58	119	9,774	エネルギー	
ONEX CORPORATION	20	193	15,842	金融	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	95	275	22,549	一般消費財・サービス	
FINNING INTERNATIONAL INC	39	103	8,503	資本財・サービス	
SNC-LAVALIN GROUP INC	14	179	14,651	資本財・サービス	
IGM FINANCIAL INC	23	92	7,532	金融	
OPEN TEXT CORP	62	273	22,409	情報技術	
CI FINANCIAL CORP	54	145	11,880	金融	
SAPUTO INC	58	258	21,191	生活必需品	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	158	171	14,044	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	98	630	51,601	生活必需品	
YAMANA GOLD INC	233	81	6,636	素材	
FORTIS INC	92	414	33,900	公益事業	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	133	155	12,747	エネルギー	
CENOVUS ENERGY INC	196	227	18,625	エネルギー	
DOLLARAMA INC	25	321	26,322	一般消費財・サービス	
ATCO LTD - CLASS I	17	87	7,147	公益事業	
ALTAGAS LTD	39	117	9,576	エネルギー	
FIRST CAPITAL REALTY INC	26	53	4,392	不動産	
KEYERA CORP	44	183	15,003	エネルギー	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	39	93	7,670	エネルギー	
INTER PIPELINE LTD	88	235	19,253	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	83	146	12,024	エネルギー	
カナダ・ドル 株数・金額 通貨計 銘柄数<比率>	9,525.66 91銘柄	39,332	3,219,376 <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	375	79	6,522	ヘルスケア	
MEDIBANK PRIVATE LTD	617	172	14,122	金融	
BHP BILLITON LIMITED	747	1,798	147,510	素材	
SOUTH32 LTD	1,272	333	27,340	素材	
LENLEAS GROUP	133	219	18,036	不動産	
ALUMINA LTD	569	112	9,266	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	174	556	45,637	エネルギー	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	355	168	13,833	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	118	132	10,832	金融	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	618	1,869	153,369	金融	
WESTPAC BANKING CORP	777.98	2,373	194,731	金融	
SANTOS LTD	428	139	11,481	エネルギー	
AUSNET SERVICES	410	69	5,718	公益事業	
AUST AND NZ BANKING GROUP	674	1,906	156,374	金融	
RIO TINTO LTD	97	609	49,991	素材	
ORIGIN ENERGY LTD	414	318	26,118	エネルギー	
AMCOR LIMITED	267	428	35,178	資本財	
AURIZON HOLDINGS LTD	468	264	21,731	資本財・サービス	
OIL SEARCH LTD	329	233	19,190	エネルギー	
SEEK LTD	75	126	10,410	資本財・サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD	171	229	18,868	生活必需品	
NWCREST MINING LTD	176	375	30,769	素材	
INCEXT PIVOT LTD	382	132	10,906	素材	

銘柄	2017年6月5日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千円	千円	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA LTD	400	3,215	263,775	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD	60	203	16,686	エネルギー
ORICA LTD	83	162	13,366	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	310	403	33,087	金融
CIMIC GROUP LTD	21	85	7,025	資本財・サービス
WOOLWORTHS LTD	300	795	65,295	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	137	128	10,565	生活必需品
TBACORP HOLDINGS LTD	205	93	7,702	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	81	107	8,851	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	102.54	52	4,340	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	986	442	36,320	電気通信サービス
AMP LTD	713	365	29,949	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	103	208	17,128	素材
MARQUARIE GROUP LTD	69.84	628	51,549	金融
ASTROCRAT LEISURE LTD	126	275	22,638	一般消費財・サービス
CNK OF QUEENSLAND LTD	91	101	8,354	金融
BSC LTD	106	1,399	114,790	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	258.95	1,086	89,162	生活必需品
COCHLEAR LTD	14	210	17,301	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	134	157	12,939	素材
SUNCORP GROUP LTD	295	423	34,753	金融
BORAL LTD	277	189	15,566	素材
ASX LTD	47	245	20,100	金融
COMPUTERSHARE LTD	104	152	12,533	情報技術
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	53	4,353	一般消費財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	549	354	29,050	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	95	227	18,658	ヘルスケア
TRANSURBAN GROUP	478	604	49,567	資本財・サービス
CHALLENGER LTD	139	179	14,687	金融
SYDNEY AIRPORT	251	192	15,814	資本財・サービス
TATTS GROUP LTD	369	154	12,684	一般消費財・サービス
AGL ENERGY LTD	155	401	32,973	公益事業
BRAMBLES LTD	373	391	32,100	資本財・サービス
APA GROUP	267	264	21,685	公益事業
RAMSAY HEALTH CARE LTD	33	232	19,094	ヘルスケア
TPG TELECOM LTD	65	36	2,991	電気通信サービス
REA GROUP LTD	12	78	6,409	一般消費財・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	14	80	6,570	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル 通貨計	17,611.31 61銘柄	27,040	2,218,373 < 2.5% >	株数・金額 銘柄数<比率>
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	330	2,352	33,364	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	550	2,494	35,368	一般消費財・サービス
MTR CORP	345	1,528	21,672	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	340	4,022	57,034	不動産
SINO LAND CO	740	1,010	14,333	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	631.69	6,436	91,275	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	320	2,188	31,037	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	125	970	13,754	不動産
FIRST PACIFIC CO	560	343	4,875	金融
CLP HOLDINGS LTD	375	3,174	45,012	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	253.86	1,306	18,520	不動産
HANG LUNG GROUP LTD	210	700	9,930	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,811.42	3,025	42,895	公益事業
HANG SENG BANK LTD	179	2,953	41,880	金融
WHEELLOCK & CO LTD	200	1,205	17,086	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,310	1,308	18,557	不動産
WH GROUP LTD	1,850	1,367	19,386	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR LTD & FUNG LTD	273	5,596	79,358	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,320	426	6,045	一般消費財・サービス
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	58	675	9,581	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	165	532	7,557	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	355	536	7,601	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	180	486	6,904	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	290.4	958	13,588	金融

銘柄	2017年6月5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	
HYSAN DEVELOPMENT CO	140	508	7,216	不動産
SJM HOLDINGS LTD	470	357	5,065	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	300	795	11,273	不動産
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	616.69	3,678	52,161	不動産
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	150	1,025	14,538	公益事業
PCCW LTD	950	432	6,129	電気通信サービス
AIA GROUP LTD	2,812	15,564	220,703	金融
SANDS CHINA LTD	572	2,007	28,469	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	300	386	5,479	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	315	1,146	16,258	一般消費財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	200	340	4,821	一般消費財・サービス
BGC HONG KONG HOLDINGS LTD	875	3,097	43,922	金融
WYNN MACAU LTD	380	679	9,634	一般消費財・サービス
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	870	899	12,756	電気通信サービス
香港・ドル 通貨計	株数・金額 22,243.06 39銘柄	株数・金額 77,593 61銘柄	株数・金額 1,100,279 < 1.3% >	株数・金額 銘柄数<比率>
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	303	707	56,579	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	415	849	67,968	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	124.7	125	10,002	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	345	224	17,933	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	132	93	7,473	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	112	121	9,682	不動産
CAPITALAND LTD	590	213	17,079	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	410	132	10,623	一般消費財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	23	101	8,148	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	742	785	62,779	金融
GENTING SINGAPORE PLC	1,530	179	14,376	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,886.5	718	57,478	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	350	129	10,356	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	227	71	5,700	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,644	60	4,798	生活必需品
SATS LTD	160	84	6,717	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	190	138	11,091	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	468	113	9,094	資本財・サービス
STARHUB LTD	160	43	3,493	電気通信サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	485	171	13,730	生活必需品
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	690	201	16,112	不動産
シンガポール・ドル 通貨計	株数・金額 10,987.2 22銘柄	株数・金額 5,267 61銘柄	株数・金額 421,218 < 0.5% >	株数・金額 銘柄数<比率>
(ニュージーランド)	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	260	75	5,949	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	526.89	199	15,716	電気通信サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	234	166	13,147	資本財・サービス
CONTACT ENERGY LTD	130	67	5,293	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	201	155	12,260	素材
RYMAN HEALTHCARE LTD	88	74	5,881	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル 通貨計	株数・金額 1,439.89 6銘柄	株数・金額 738 61銘柄	株数・金額 58,248 < 0.1% >	株数・金額 銘柄数<比率>
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT	163	87	12,443	一般消費財・サービス
TUI AG-DI	117.47	140	20,006	一般消費財・サービス
BP PLC	4,405	2,038	289,780	エネルギー
UNILEVER PLC	295.6	1,292	183,743	生活必需品
BARCLAYS PLC	3,955	834	118,577	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	434	386	55,003	資本財・サービス
MARSH & SPENCER GROUP PLC	381	140	19,915	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	21.5	164	23,397	素材
PRUDENTIAL PLC	592	1,046	148,708	金融
INMARSAT PLC	103	86	12,343	電気通信サービス
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	838.91	216	30,816	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	45.64	143	20,424	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2017年6月5日現在			業種等
	株数	評価額	金額	
	千株	千円	千円	
BAE SYSTEMS PLC	727	487	69,244	資本財・サービス
AVIVA PLC	939.66	499	71,065	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,135.02	1,936	275,270	ヘルスケア
WORLDPAY GROUP PLC	427	133	18,933	情報技術
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	80	63	9,069	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	224	97	13,880	情報技術
DCC PLC	20	150	21,437	資本財・サービス
CONVATEC GROUP PLC	275	94	13,393	ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC	224	98	13,982	資本財・サービス
RELX PLC	255.46	429	61,011	資本財・サービス
DIAGEO PLC	586	1,383	196,726	生活必需品
RIO TINTO PLC	286.5	904	128,540	素材
STANDARD CHARTERED PLC	761	566	80,596	金融
TESCO PLC	1,911	348	49,592	生活必需品
FRESNILLO PLC	50	82	11,735	素材
SMITH & NEPHEW PLC	203	278	39,651	ヘルスケア
GLENCORE PLC	2,851.25	817	116,229	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	65	92	13,084	金融
SMITHS GROUP PLC	93.33	151	21,586	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	61	57	8,134	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	310.83	107	15,315	金融
DIXONS CARPHONE PLC	248	80	11,387	一般消費財・サービス
PEARSON PLC	188.63	134	19,159	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	381.25	104	14,910	生活必需品
NEXT PLC	33	143	20,458	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	739	136	19,414	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	43.11	182	25,892	一般消費財・サービス
IMI PLC	66.5	84	11,958	資本財・サービス
BUNZL PLC	77.55	188	26,855	資本財・サービス
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	206	59	8,492	金融
GKN PLC	406	144	20,547	一般消費財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	6,136.83	1,411	200,611	電気通信サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	29.93	120	17,104	素材
KINGFISHER PLC	519.11	171	24,316	一般消費財・サービス
WPP PLC	298	522	74,305	一般消費財・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	159.27	159	22,687	公益事業
SEVERN TRENT PLC	57.33	141	20,171	公益事業
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	154	1,234	175,513	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	119	141	20,182	金融
SCHRODERS PLC	32	101	14,366	金融
TATE & LYLE PLC	114	84	12,041	生活必需品
SSE PLC	239	354	50,454	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	54	98	13,971	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	227	134	19,184	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	290.5	1,558	221,519	ヘルスケア
WOLSELEY PLC	59.65	300	42,696	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,381	351	50,003	金融
3I GROUP PLC	229.91	213	30,412	金融
SKY PLC	245	242	34,480	一般消費財・サービス
ASHTED GROUP PLC	114	183	26,059	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	242.14	176	25,094	情報技術
NATIONAL GRID PLC	802.34	829	117,938	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	16,499.65	1,144	162,666	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	242.6	151	21,555	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	222.5	811	115,420	生活必需品
CENTRICA PLC	1,283.6	254	36,203	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	30	95	13,617	一般消費財・サービス
PROVIDENT FINANCIAL PLC	36.5	111	15,872	金融
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	433.6	2,418	343,831	生活必需品
BHP BILLITON PLC	485.77	575	81,832	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	81	242	34,510	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	4,600	3,120	443,630	金融
SHIRE PLC	210.74	959	136,432	ヘルスケア
OLD MUTUAL PLC	1,170.25	230	32,773	金融
ANGLO AMERICAN PLC	320.83	330	46,954	素材
MONDI PLC	83	170	24,271	素材

銘柄	2017年6月5日現在			業種等
	株数	評価額	金額	
	千株	千円	千円	
WM MORRISON SUPERMARKETS	509	125	17,880	生活必需品
CARNIVAL PLC	45.11	231	32,929	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	35	48	6,911	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	377.41	637	90,672	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	70.5	169	24,033	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	1,966	595	84,726	電気通信サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	44	102	14,542	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	104.89	190	27,108	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	42.86	191	27,223	一般消費財・サービス
CAPITA PLC	150.9	89	12,667	資本財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC	59	94	13,495	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	38	164	23,391	資本財・サービス
ITV PLC	868	166	23,617	一般消費財・サービス
PETROFAC LTD	56	20	2,961	エネルギー
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	71.49	248	35,397	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,007	2,101	298,764	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	872.18	1,862	264,778	エネルギー
MEGGITT PLC	177	89	12,669	資本財・サービス
G4S PLC	346	113	16,133	資本財・サービス
COBHAM PLC	556	76	10,883	資本財・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	33	55	7,881	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	52	107	15,309	金融
INVESTEC PLC	160	95	13,601	金融
ANTOFAGASTA PLC	98	78	11,215	素材
STANDARDF LIFE PLC	454.63	174	24,792	金融
EXPERIAN PLC	220.54	352	50,163	資本財・サービス
イギリス・ボンド 通貨計	70,845.77 104銘柄	株数、金額 銘柄数<比率>	6,249,159 <7.2%>	
(イスラエル)	千株	千円		
AZRIELI GROUP LTD	10	193	6,027	不動産
FRUTAROM	9	208	6,481	素材
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM.CO	564	342	10,681	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD	140	210	6,554	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	6	265	8,262	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	265	630	19,638	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	334	576	17,947	金融
NICE LTD	14	397	12,376	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	30	189	5,917	金融
イスラエル・シュケル 通貨計	1,372 9銘柄	株数、金額 銘柄数<比率>	3,014 <0.1%>	
(スイス)	千株	千円		
DUFREY AG-REG	10.5	171	19,617	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	855	1,320	151,312	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	136	15,622	素材
ADECCO GROUP AG-REG	37.5	273	31,398	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	163.5	4,331	496,432	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	8	60	6,890	金融
SIKA AG-BR	0.5	315	36,191	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	144	16,553	生活必需品
ABB LTD-REG	462	1,147	131,485	資本財・サービス
SWISS RE AG	75.5	668	76,629	金融
NESTLE SA-REG	724	6,005	688,359	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	4.2	251	28,836	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	208	23,932	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	465.2	621	71,237	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	52	259	29,741	金融
SGS SA-REG	1.3	301	34,599	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	5	100	11,559	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	9	99	11,440	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	7	267	30,689	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	35.22	1,001	114,769	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	12	178	20,439	金融
NOVARTIS AG-REG	518.5	4,116	471,877	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.5	69	8,000	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	122	994	113,966	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	5.9	273	31,317	電気通信サービス

銘柄	2017年6月5日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千円	千円		
GEBERIT AG-REG	8.5	387	44,407	資本財・サービス	
GIVAUDAN-REG	2.1	422	48,477	素材	
ACTELION LTD-REG	22.5	612	70,211	ヘルスケア	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2	108	12,482	ヘルスケア	
SONOVA HOLDING AG-REG	12	193	22,227	ヘルスケア	
LONZA GROUP AG-REG	17.5	361	41,460	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	11	82	9,443	一般消費財・サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	104.9	604	69,256	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	7.7	248	28,533	金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	12.5	197	22,580	資本財・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	16.5	148	16,973	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.23	136	15,659	生活必需品	
スイス・フラン 通貨計	3,803.77 37銘柄	26,824	3,074,614 < 3.5% >		
(デンマーク)	百株	千円	千円		
NOVO NORDISK A/S-B	445.5	12,986	217,391	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S	158.5	3,933	65,854	金融	
ISS A/S	39	1,070	17,921	資本財・サービス	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.85	1,048	17,558	資本財・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52	2,984	49,965	資本財・サービス	
TDC A/S	193	753	12,609	電気通信サービス	
CARLSBERG AS-B	24.5	1,784	29,877	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	55	1,686	28,228	素材	
COLOPLAST-B	28	1,624	27,185	ヘルスケア	
DSV A/S	42.5	1,725	28,891	資本財・サービス	
WILLIAM DEMANT HOLDING	26.75	468	7,845	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1.5	1,932	32,341	資本財・サービス	
TRYG A/S	25	342	5,733	金融	
PANDORA A/S	25.5	1,597	26,743	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	23.5	1,119	18,737	素材	
GENMAB A/S	13	1,888	31,620	ヘルスケア	
DONG ENERGY A/S	34	993	16,630	公益事業	
デンマーク・クローネ 通貨計	1,188.1 17銘柄	37,941	635,137 < 0.7% >		
(ノルウェー)	百株	千円	千円		
NORSK HYDRO ASA	306	1,387	18,202	素材	
DNB ASA	225.5	3,211	42,129	金融	
ORKLA ASA	190.5	1,630	21,394	生活必需品	
TELENOR ASA	180	2,482	32,566	電気通信サービス	
STATOIL ASA	259.73	3,799	49,854	エネルギー	
SCHIBSTED ASA-CL A	15	304	3,995	一般消費財・サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	41.6	1,326	17,405	素材	
MARINE HARVEST	87	1,296	17,007	生活必需品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	48.5	664	8,717	金融	
SCHIBSTED ASA-B SHS	18	337	4,428	一般消費財・サービス	
ノルウェー・クローネ 通貨計	1,371.83 10銘柄	16,440	215,701 < 0.2% >		
(スウェーデン)	百株	千円	千円		
ICA GRUPPEN AB	19	599	7,668	生活必需品	
ERICSSON LM-B SHS	710.3	4,549	58,233	情報技術	
VOLVO AB-B SHS	353	5,185	66,375	資本財・サービス	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	15	749	9,590	電気通信サービス	
SKF AB-B SHARES	94.5	1,718	22,002	資本財・サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	54.5	1,536	19,672	一般消費財・サービス	
NORDEA BANK AB	708.5	7,843	100,391	金融	
SWEDISH MATCH AB	45.5	1,351	17,297	生活必需品	
TELE2 AB-B SHS	89.5	809	10,356	電気通信サービス	
GETINGE AB-B SHS	47	864	11,069	ヘルスケア	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	349.5	3,652	46,749	金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	352	4,266	54,607	金融	
SWEDBANK AB - A SHARES	209	4,338	55,537	金融	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	218	4,765	60,998	一般消費財・サービス	

銘柄	2017年6月5日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千円	千円		
SVENSKA CELLULOSA AB SCAB	141	4,276	54,739	生活必需品	
SKANSKA AB-B SHS	76.5	1,598	20,455	資本財・サービス	
SANDVIK AB	244.5	3,381	43,282	資本財・サービス	
INVESTOR AB-B SHS	104	4,219	54,006	金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	157	5,030	64,387	資本財・サービス	
SECURITAS AB-B SHS	74	1,065	13,639	資本財・サービス	
TELIA CO AB	600	2,391	30,612	電気通信サービス	
ALFA LAVAL AB	70	1,221	15,635	資本財・サービス	
ATLAS COPCO AB-B SHS	91	2,609	33,406	資本財・サービス	
ASSA ABLOY AB-B	233	4,557	58,335	資本財・サービス	
LUNDBERGS AB-B SHS	9	621	7,960	金融	
LUNDIRN PETROLEUM AB	42	704	9,020	エネルギー	
BOLIDEN AB	65	1,550	19,843	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	97.5	876	11,219	一般消費財・サービス	
KINNEVIK AB - B	53	1,337	17,122	金融	
HEXAGON AB-B SHS	62	2,405	30,791	情報技術	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	35	732	9,376	金融	
スウェーデン・クローネ 通貨計	5,419.8 31銘柄	80,811	1,034,385 < 1.2% >		
ユーロ (アイルランド)	百株	千円	千円		
BANK OF IRELAND	6,618	158	19,698	金融	
KERRY GROUP PLC-A	38.5	306	38,128	生活必需品	
CRH PLC	194	629	78,377	素材	
PADDY POWER BETFAIR PLC	19	185	23,153	一般消費財・サービス	
国小計	6,869.5 4銘柄	1,279	159,358 < 0.2% >		
ユーロ (オランダ)	百株	千円	千円		
QIAGEN N.V.	52.48	159	19,872	ヘルスケア	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	219.76	704	87,744	資本財・サービス	
NN GROUP NV	74.5	240	29,899	金融	
UNILEVER NV-CVA	379.5	1,938	24,466	生活必需品	
HEINEKEN NV	53	467	58,164	生活必需品	
RELX NV	227.19	418	52,146	資本財・サービス	
AEGON NV	407.44	180	22,504	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	294.83	580	72,353	生活必需品	
AKZO NOBEL	58	439	54,716	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	41	275	34,277	素材	
WOLTERS KLUWER	69	268	33,440	資本財・サービス	
BOSKALIS WESTMINSTER	21	63	7,950	資本財・サービス	
ING GROEP NV	903.5	1,348	167,995	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	782.5	238	29,742	電気通信サービス	
ASML HOLDING NV	86	1,022	127,400	情報技術	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	66	150	18,777	金融	
VOPAK	16	65	8,105	エネルギー	
HANDESTAD HOLDING NV	26	135	16,928	資本財・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	23	192	23,983	生活必需品	
GEMALTO	20	105	13,138	情報技術	
ALTICE NV - A	84	190	23,668	一般消費財・サービス	
ALTICE NV - B	29	65	8,174	一般消費財・サービス	
AIRBUS SE	135.5	1,024	127,576	資本財・サービス	
EXOR NV	25	126	15,801	金融	
CNH INDUSTRIAL NV	243	241	30,066	資本財・サービス	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	250.5	244	30,510	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	28.35	227	28,333	一般消費財・サービス	
国小計	4,616.05 27銘柄	11,118	1,384,741 < 1.6% >		
ユーロ (ベルギー)	百株	千円	千円		
UCB SA	27.5	175	21,895	ヘルスケア	
KBC GROEP NV	58	383	47,746	金融	
COLRUYT SA	16	79	9,906	生活必需品	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	18.5	161	20,072	金融	
SOLVAY SA	17	200	24,993	素材	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2017年6月5日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	千ユーロ	千円	千円		
UMICORE	22.5	138	17,266	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	177	1,856	231,237	生活必需品	
AGEAS	44.9	162	20,278	金融	
PROXIMUS	35	113	14,164	電気通信サービス	
TELENOR GROUP HOLDING NV	12	72	8,968	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	428.4 10銘柄	416,528 < 0.5% >		
ユーロ (ルクセンブルク)	株数	千ユーロ	千円		
RTL GROUP	10	70	8,751	一般消費財・サービス	
ARCELORMITTAL	141	265	33,056	素材	
EUROFINS SCIENTIFIC	2.7	132	16,552	ヘルスケア	
SES	83.5	191	23,881	一般消費財・サービス	
TENARIS SA	105.5	143	17,816	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	342.7 5銘柄	100,058 < 0.1% >		
ユーロ (フランス)	株数	千ユーロ	千円		
JCDECAUX SA	16	48	6,031	一般消費財・サービス	
TOTAL SA	528.5	2,473	308,034	エネルギー	
MICHELIN (CGDE)	42.5	495	61,689	一般消費財・サービス	
AIR LIQUIDE SA	90.48	1,005	125,191	素材	
KERING	18	539	67,217	一般消費財・サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	132	918	114,450	資本財・サービス	
BOUYGUES SA	50	191	23,899	資本財・サービス	
BNP PARIBAS	258.5	1,638	204,107	金融	
PEUGEOT SA	112.5	201	25,093	一般消費財・サービス	
NATIXIS	229.5	136	17,043	金融	
THALES SA	25.5	252	31,487	資本財・サービス	
DANONE	138.5	932	116,118	生活必需品	
CARREFOUR SA	128	299	37,310	生活必需品	
SUEZ	74.75	121	15,085	公益事業	
VIVENDI	237.41	472	58,897	一般消費財・サービス	
L'OREAL	58.5	1,128	140,539	生活必需品	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	115	575	71,610	資本財・サービス	
LEGRAND SA	60.67	368	45,901	資本財・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	13	71	8,880	生活必需品	
PERNOD RICARD SA	49.17	602	75,014	生活必需品	
SOCIETE BIC SA	7	77	9,633	資本財・サービス	
EURAZEO	8.66	55	6,928	金融	
REXEL SA	70.5	112	14,008	資本財・サービス	
SOCIETE GENERALE SA	180	851	106,033	金融	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	64.4	1,490	185,631	一般消費財・サービス	
ACCOR SA	40	173	21,595	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI	37.5	351	43,834	情報技術	
VALEO SA	56.5	364	45,441	一般消費財・サービス	
PUBLICIS GROUPE	43.5	297	37,006	一般消費財・サービス	
BUREAU VERITAS SA	60.5	124	15,532	資本財・サービス	
EIFFAGE	13	106	13,220	資本財・サービス	
SODEXO SA	21.5	264	33,001	一般消費財・サービス	
IPSEN	9	108	13,573	ヘルスケア	
INGENICO GROUP	13.5	117	14,595	情報技術	
ZODIAC AEROSPACE	48	113	14,107	資本財・サービス	
SEB SA	5	80	9,991	一般消費財・サービス	
ESSILOR INTERNATIONAL	47.5	566	70,514	ヘルスケア	
DASSAULT AVIATION SA	0.6	81	10,133	資本財・サービス	
AXA SA	455	1,086	135,346	金融	
CHRISTIAN DIOR SE	13	333	41,527	一般消費財・サービス	
LAGARDERE SCA	26.5	75	9,341	一般消費財・サービス	
EDENRD	47.5	111	13,872	資本財・サービス	
RENAULT SA	44	374	46,693	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL	6.2	278	34,704	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU	5.5	54	6,734	生活必需品	
ATOS SE	21.5	280	34,969	情報技術	
DASSAULT SYSTEMES SA	30.5	255	31,789	情報技術	
WENDEL	6	82	10,214	金融	
ORANGE	468	727	90,632	電気通信サービス	
ALSTOM	36.5	114	14,259	資本財・サービス	

銘柄	2017年6月5日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	千ユーロ	千円	千円		
CNP ASSURANCES	37.5	74	9,244	金融	
SANOFI	267.75	2,379	296,342	ヘルスケア	
VINCI SA	119	929	115,731	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	114.5	221	27,614	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA	257	354	44,137	金融	
ENGIE	371.73	501	62,498	公益事業	
IMERYS SA	9	70	8,817	素材	
EDF	127.5	123	15,439	公益事業	
SAFRAN SA	72	574	71,537	資本財・サービス	
ILIAD SA	6	138	17,246	電気通信サービス	
ARKEMA	15.5	148	18,485	素材	
ADP	7.5	105	13,118	資本財・サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	40.5	97	12,107	一般消費財・サービス	
SCOR SE	36.5	129	16,105	金融	
GROUPE EURO TUNNEL SE - REGR	104.5	111	13,925	資本財・サービス	
BOLLORE	190	78	9,815	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,041.82 66銘柄	3,440,643 < 3.9% >		
ユーロ (ドイツ)	株数	千ユーロ	千円		
BAYER AG-REG	191.5	2,328	290,008	ヘルスケア	
EVONIK INDUSTRIES AG	38	118	14,796	素材	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	476.5	742	92,516	金融	
COMMERZBANK AG	246.85	230	28,756	金融	
VOLKSWAGEN AG	8	113	14,137	一般消費財・サービス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	43	591	73,661	一般消費財・サービス	
MAN SE	8.5	80	10,015	資本財・サービス	
SIEMENS AG-REG	177	2,292	285,464	資本財・サービス	
E.ON SE	517	404	50,434	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	76	653	81,333	一般消費財・サービス	
GEA GROUP AG	42	156	19,547	資本財・サービス	
OSRAM LICHT AG	21.6	151	18,830	資本財・サービス	
CONTINENTAL AG	25.5	515	64,150	一般消費財・サービス	
BASF SE	212.5	1,812	225,770	素材	
LINDE AG	43	758	94,519	素材	
K+S AG-REG	44	101	12,639	素材	
ALLIANZ SE-REG	106.5	1,846	229,922	金融	
THYSSENKRUPP AG	85	199	24,887	素材	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	41	521	64,975	生活必需品	
RVW AG	118	214	26,687	公益事業	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50.5	89	11,185	資本財・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	9	67	8,437	資本財・サービス	
BRENNTAG AG	36.5	193	24,124	資本財・サービス	
FRESENIUS SE & CO KGAA	94.5	725	90,397	ヘルスケア	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	27	133	16,644	情報技術	
HOCHTIEF AG	5	82	10,246	資本財・サービス	
SAP SE	227.42	2,185	272,182	情報技術	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	37.2	659	82,187	金融	
SCHAEFFLER AG	38	57	7,108	一般消費財・サービス	
ZALANDO SE	19	82	10,247	一般消費財・サービス	
HEIDELBERGCEMENT AG	35	293	36,501	素材	
COVESTRO AG	21	141	17,609	素材	
INNOGY SE	34	125	15,599	公益事業	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PREF	34.5	181	22,591	一般消費財・サービス	
BEIERSDORF AG	23	222	27,670	生活必需品	
FUCHS PETROLUB SE - PREF	15	76	9,482	素材	
MERCK KGAA	29.5	319	39,825	ヘルスケア	
ADIDAS AG	44.1	756	94,191	一般消費財・サービス	
HENKEL AG & CO KGAA	24	268	33,446	生活必需品	
METRO AG	41	122	15,313	生活必需品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	758	1,317	164,069	電気通信サービス	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	50.5	437	54,427	ヘルスケア	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	225	1,481	184,493	一般消費財・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	259	520	64,818	情報技術	
HANNOVER RUECK SE	14	149	18,664	金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	225	734	91,448	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	44.5	416	51,878	金融	

銘柄	2017年6月5日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ユーロ	千円		
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	55.5	213	26,541	一般消費財・サービス	
LANXESS AG	22	149	18,677	素材	
AXEL SPRINGER SE	10	57	7,184	一般消費財・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	84	298	37,221	不動産	
SYMRIS AG	30	195	24,356	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	165	73	9,195	電気通信サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	12	88	10,966	一般消費財・サービス	
HUGO BOSS AG -ORD	16.5	112	14,024	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	109	391	48,740	不動産	
国小計	株数、金額 総株数<比率>	5,446.67 56銘柄	27,258 3,394,758 < 3.9%>		
ユーロ (ポルトガル)	株数	千ユーロ	千円		
JERONIMO MARTINS	60	105	13,151	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	495	160	19,973	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	116.5	159	19,906	エネルギー	
国小計	株数、金額 総株数<比率>	671.5 3銘柄	425 53,031 < 0.1%>		
ユーロ (スペイン)	株数	千ユーロ	千円		
TELEFONICA SA	1,046.27	1,047	130,497	電気通信サービス	
ENDESA SA	76.5	168	21,002	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,537.12	1,112	138,578	金融	
IBERDROLA SA	1,329.34	950	118,322	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	1,229.09	223	27,843	金融	
BANKINTER SA	151	123	15,403	金融	
REPSOL SA	258	382	47,618	エネルギー	
GRIFOLS SA	67	169	21,169	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	3,365.5	1,958	243,939	金融	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	149	243	30,339	資本財・サービス	
AMADEUS IT GROUP SA	101	531	66,188	情報技術	
GAS NATURAL SDG SA	84.5	187	23,346	公益事業	
MAPFRE SA	254.5	81	10,120	金融	
CAIXABANK S.A	816	336	41,910	金融	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	201	139	17,412	資本財・サービス	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	53.76	191	23,845	資本財・サービス	
AENA SA	16	292	36,375	資本財・サービス	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	253	927	115,526	一般消費財・サービス	
GANESA CORP TECNOLOGICA SA	56	111	13,892	資本財・サービス	
ENAGAS SA	54	143	17,851	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	100	201	25,125	公益事業	
FERROVIAL SA	117	238	29,652	資本財・サービス	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	157	86	10,785	生活必需品	
BANKIA SA	1,084.22	111	13,894	金融	
国小計	株数、金額 総株数<比率>	12,556.8 24銘柄	9,961 1,240,643 < 1.4%>		
ユーロ (イタリア)	株数	千ユーロ	千円		
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	217.5	43	5,471	金融	
PRYSMIAN SPA	48	123	15,351	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	290.43	408	50,819	金融	
SAIPEM SPA	134.3	47	5,977	エネルギー	
MEDIOBANCA SPA	130.15	109	13,631	金融	
UNICREDIT SPA	439.56	680	84,796	金融	
TELECOM ITALIA SPA	2,662.82	223	27,790	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	1,349.5	92	11,487	電気通信サービス	
INTESA SANPAOLO-RSP	210	50	6,344	金融	
INTESA SANPAOLO	2,938.97	761	94,799	金融	
ATLANTIA SPA	106.07	276	34,398	資本財・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	118	74	9,309	金融	
RECORDATI SPA	26	98	12,272	ヘルスケア	
ENI SPA	588	826	102,887	エネルギー	
LEONARDO SPA	95.25	150	18,754	資本財・サービス	
ENEL SPA	1,878.34	888	110,648	公益事業	
SNAM SPA	582	239	29,848	エネルギー	
LUXOTTICA GROUP SPA	38.5	208	25,963	一般消費財・サービス	
TERNA SPA	354	179	22,374	公益事業	
国小計	株数、金額 総株数<比率>	12,207.39 19銘柄	5,483 682,926 < 0.8%>		

銘柄	2017年6月5日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ユーロ	千円		
ユーロ (フィンランド)	株数	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ	124	315	39,240	素材	
NOKIA OYJ	1,341.5	782	97,402	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP	32	173	21,620	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS	131	148	18,517	素材	
METSO OYJ	24	74	9,244	資本財・サービス	
ELISA OYJ	32.5	114	14,259	電気通信サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	103	469	58,532	金融	
FORTUM OYJ	104.5	151	18,831	公益事業	
KONE OYJ-B	78.5	350	43,612	資本財・サービス	
NOKIAN RENKAAT OYJ	26.5	97	12,155	一般消費財・サービス	
NESTE OYJ	29.5	104	13,020	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	24.5	142	17,758	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 総株数<比率>	2,051.5 12銘柄	2,924 364,194 < 0.4%>		
ユーロ (オーストリア)	株数	千ユーロ	千円		
OMV AG	35.5	164	20,538	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	66.5	217	27,098	金融	
VOESTALPINE AG	28.5	112	13,959	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	24	56	7,006	金融	
ANDRITZ AG	16	86	10,812	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 総株数<比率>	170.5 5銘柄	637 79,414 < 0.1%>		
ユーロ (その他)	株数	千ユーロ	千円		
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	52	189	23,640	生活必需品	
STMICROELECTRONICS NV	153	225	28,067	情報技術	
国小計	株数、金額 総株数<比率>	205 2銘柄	415 51,708 < 0.1%>		
ユーロ通貨計	株数、金額 総株数<比率>	51,607.83 233銘柄	91,279 11,368,008 < 13.0%>		
ファンド合計	株数、金額 総株数<比率>	267,939.96 1,257銘柄	二 83,703,926 < 96.0%>		

(注1) 邦貨換算金額は、2017年6月5日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	2017年6月5日現在		
	□ 数	評 価	額
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,097	605	66,945
SIMON PROPERTY GROUP INC	7,087	1,081	119,523
BOSTON PROPERTIES INC	3.55	434	47,994
GGP INC	12.8	287	31,806
VORNADO REALTY TRUST	3.827	355	39,269
SBA COMMUNICATIONS CORP	2.75	381	42,140
EQUITY RESIDENTIAL	8.2	547	60,449
EQUINIX INC	1.758	781	86,305
AMERICAN TOWER CORP	9.75	1,291	142,728
HOST HOTELS & RESORTS INC	17.293	314	34,717
KIMCO REALTY CORP	10	176	19,446
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	12	172	19,079
VENTAS INC	7.9	530	58,569
WEYERHAEUSER CO	16.814	563	62,254
AGNC INVESTMENT CORP	7.8	162	17,968
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6.9	125	13,829
CROWN CASTLE INTL CORP	8.25	862	95,338
IRON MOUNTAIN INC	5.61	197	21,855
VEREIT INC	22.3	186	20,598
PROLOGIS INC	11.912	677	74,863
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.9	228	25,200
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	169	18,705
DUKE REALTY CORP	8	233	25,792
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.48	388	42,946
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1.6	197	21,809
WELLTOWER INC	8.4	619	68,485
HCP INC	10.7	341	37,713
LIBERTY PROPERTY TRUST	3.3	138	15,335
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2.6	271	29,959
MACERICH CO/THE	2.7	156	17,243
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23.2	279	30,837
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	3.4	132	14,594
REALTY INCOME CORP	6	339	37,509
PUBLIC STORAGE	3.35	716	79,180
REGENCY CENTERS CORP	3.5	213	23,554
SL GREEN REALTY CORP	2.25	232	25,683
UDR INC	6.3	247	27,391
DIGITAL REALTY TRUST INC	3.7	443	48,963
EXTRA SPACE STORAGE INC	2.75	210	23,232
アメリカ・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	276,728 15,293	1,689,824 <1.9%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	1.5	47	3,917
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3	69	5,652
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3.3	84	6,898
カナダ・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	7.8 3銘柄	16,468 <0.0%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円
SCENTRE GROUP	122.222	531	43,617
DEXUS	23.95	251	20,611
GPT GROUP	44.06	234	19,230

銘柄	2017年6月5日現在		
	□ 数	評 価	額
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千オーストラリア・ドル	千円
MIRVAC GROUP	84.4	192	15,787
STOCKLAND	57	273	22,446
WESTFIELD CORP	45.496	392	32,211
GOODMAN GROUP	41.7	359	29,489
VICINITY CENTRES	82.873	233	19,172
オーストラリア・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	501.701 8銘柄	2,469 <0.2%>
(香港)	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT	52	3,224	45,716
香港ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	52 1銘柄	3,224 <0.1%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	46	76	6,106
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	57.4	154	12,347
CAPITALAND MALL TRUST	63.2	123	9,880
SUNTEC REIT	53	97	7,798
シンガポール・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	219.6 4銘柄	451 <0.0%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	18.2	195	27,787
SEGRO PLC	23.75	118	16,915
HAMMERSON PLC	19.2	112	16,008
BRITISH LAND CO PLC	22.1	139	19,792
INTU PROPERTIES PLC	21.1	57	8,155
イギリス・ポンド 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	104.35 5銘柄	623 <0.1%>
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO SE	2.35	554	69,113
ICADE	0.9	67	8,395
GECINA SA	0.95	132	16,445
KLEPIERRE	5.2	198	24,693
FONCIERE DES REGIONS	0.75	63	7,932
ユーロ通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	10.15 5銘柄	1,016 <0.1%>
合 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	1,172.329 65銘柄	2,205,951 <2.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、2017年6月5日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2017年6月5日現在	
	買 建 額	売 建 額
外国 S & P 500 (アメリカ)	百万円 1,212	百万円 -

(注1) 外貨建の評価額は、2017年6月5日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ・ライフ・バランス50）が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2016年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2017年6月5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36～53ページに併せて掲載いたしました。

■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2016年6月7日から2017年6月5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% 2026/11/15	607,595	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.625% 2017/8/31	671,971
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.5% 2026/8/15	578,928	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.625% 2017/9/30	558,858
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.125% 2024/3/31	556,076	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.75% 2018/4/30	473,140
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	3% 2047/2/15	467,890	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.625% 2018/4/30	463,595
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2027/2/15	446,563	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	3.5% 2018/2/15	441,094
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.5% 2020/5/15	442,901	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.75% 2017/6/30	403,601
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.25% 2019/5/31	441,765	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	4.25% 2017/10/25	394,944
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.625% 2026/5/15	420,386	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% 2046/8/15	409,239	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	4% 2018/4/25	379,171
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.875% 2046/11/15	405,454	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.625% 2017/5/31	364,282

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

■組入資産明細表

下記は、2017年6月5日現在における外国債券インデックスマザーファンド（59,593,264千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2017年6月5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		
		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 617,458	千アメリカ・ドル 630,931	千円 69,711,613	% 43.5	% -	% 18.2	% 17.6	% 7.8
カナダ	千カナダ・ドル 35,945	千カナダ・ドル 39,852	3,261,905	2.0	-	0.9	0.6	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 37,481	千オーストラリア・ドル 40,686	3,337,940	2.1	-	1.4	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,388	千シンガポール・ドル 7,797	623,529	0.4	-	0.2	0.1	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 62,478	千イギリス・ポンド 80,743	11,478,528	7.2	-	5.2	1.6	0.4
スイス	千スイス・フラン 2,187	千スイス・フラン 2,636	302,155	0.2	-	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 46,136	千デンマーク・クローネ 57,754	966,808	0.6	-	0.4	0.2	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 32,177	千ノルウェー・クローネ 34,447	451,956	0.3	-	0.2	0.1	0.1

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	2017年6月5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			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 51,650	千スウェーデン・クローネ 59,417	千円 760,540	% 0.5	% -	% 0.2	% 0.2	% 0.1	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 232,260	千メキシコ・ペソ 238,743	1,408,588	0.9	-	0.5	0.2	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 26,234	千マレーシア・リンギット 26,378	682,936	0.4	-	0.3	0.1	0.0	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 111,523	千南アフリカ・ランド 104,048	894,821	0.6	-	0.5	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 34,924	千ポーランド・ズロチ 35,778	1,064,765	0.7	-	0.3	0.3	0.1	
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 8,886	千ユーロ 10,191	1,269,245	0.8	-	0.4	0.3	0.1	
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 23,198	千ユーロ 27,821	3,464,855	2.2	-	1.5	0.5	0.2	
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 26,687	千ユーロ 32,802	4,085,191	2.6	-	1.9	0.5	0.2	
ユーロ (フランス)	千ユーロ 106,559	千ユーロ 126,360	15,736,904	9.8	-	6.1	2.8	0.9	
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 78,046	千ユーロ 92,656	11,539,485	7.2	-	4.3	2.0	1.0	
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 61,348	千ユーロ 71,683	8,927,417	5.6	-	3.5	1.5	0.6	
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 108,029	千ユーロ 121,544	15,137,131	9.4	-	5.6	2.8	1.1	
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 6,988	千ユーロ 7,829	975,136	0.6	-	0.4	0.2	0.0	
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 15,683	千ユーロ 18,954	2,360,597	1.5	-	0.9	0.4	0.1	
ユーロ (小計)	435,424	509,843	63,495,967	39.6	-	24.5	10.9	4.3	
合 計	-	-	158,442,056	98.9	-	52.7	32.6	13.7	

(注1) 邦貨換算金額は、2017年6月5日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

2017年6月5日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.0000	%	千アメリカ・ドル 3,173	千アメリカ・ドル 3,277	千円 362,154	2018/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500		2,488	2,577	284,754	2018/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500		3,161	3,240	358,084	2019/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250		3,096	3,206	354,248	2019/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250		2,621	2,751	304,050	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750		4,020	4,215	465,734	2019/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250		4,280	4,533	500,878	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000		3,073	3,256	359,840	2020/05/15

2017年6月5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	2.6250	2,854	2,955	326,520	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,509	4,676	516,682	2020/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,076	4,377	483,674	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,698	298,154	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,322	1,337	147,738	2018/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,065	1,078	119,123	2018/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,341	1,356	149,908	2018/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,584	285,558	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,444	3,455	381,832	2018/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,835	2,840	313,824	2018/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,320	1,329	146,888	2018/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,184	241,415	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,165	2,169	239,706	2018/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,861	1,864	205,998	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,426	1,425	157,520	2019/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,270	361,310	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,843	1,846	204,005	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	300	301	33,282	2019/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	559	558	61,727	2019/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,462	272,075	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,385	2,377	262,704	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,368	1,360	150,269	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,784	1,767	195,318	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,525	279,042	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,872	1,859	205,414	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,215	2,198	242,956	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	884	882	97,501	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,168	3,138	346,805	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,353	1,341	148,271	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,894	1,883	208,098	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,366	1,366	150,970	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,390	485,135	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,968	1,961	216,687	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,160	1,151	127,202	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,654	514,286	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,451	1,439	159,030	2020/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	3,407	3,400	375,701	2018/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,461	2,456	271,404	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,693	1,695	187,379	2018/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,131	2,158	238,479	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,827	2,873	317,452	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,697	1,699	187,809	2018/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,768	2,867	316,849	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,993	2,032	224,626	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,885	1,915	211,672	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,611	3,611	399,039	2018/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,345	2,364	261,244	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,276	583,024	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,638	2,638	291,551	2018/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,501	2,541	280,803	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,026	2,033	224,674	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,006	2,064	228,134	2020/12/31

外国債券インデックスマザーファンド

2017年6月5日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,493	606,951	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,185	2,193	242,381	2019/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,647	1,680	185,658	2021/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,373	2,382	263,236	2019/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,734	1,761	194,612	2021/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,383	2,398	264,982	2019/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,821	2,891	319,434	2021/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	5,412	5,599	618,709	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,975	2,994	330,864	2019/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,407	2,466	272,513	2021/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,241	2,250	248,640	2019/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,732	2,773	306,480	2021/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,885	2,904	320,880	2019/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,485	3,553	392,577	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.8750	904	1,021	112,831	2019/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.1250	724	830	91,759	2019/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.7500	642	787	86,983	2020/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,676	295,700	2021/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	821	90,777	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,120	123,834	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.5000	630	864	95,553	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	969	107,077	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	925	102,303	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	961	106,181	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	473	618	68,307	2029/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	964	1,392	153,867	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,241	1,691	186,886	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,926	2,512	277,574	2036/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	547	759	83,866	2039/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	706	78,012	2038/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,019	1,335	147,526	2038/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	849	968	106,989	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,417	156,632	2039/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	760	993	109,747	2039/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,555	171,826	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,710	2,274	251,345	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,478	1,902	210,164	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,591	1,908	210,850	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,860	205,524	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,754	2,381	263,158	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,762	194,708	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,367	1,611	178,026	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,545	170,736	2041/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,728	191,022	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,853	1,928	213,134	2042/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,731	1,720	190,122	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,030	3,010	332,585	2042/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,026	2,153	237,895	2043/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,998	4,057	448,329	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,314	3,834	423,717	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	3,581	4,233	467,778	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,617	4,191	463,085	2044/02/15	

2017年6月5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	3.3750	3,657	4,065	449,232	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,326	3,348	369,984	2019/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,903	320,759	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,662	5,806	641,572	2024/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,729	3,964	438,056	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,989	3,009	332,510	2019/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,319	145,801	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,404	3,436	379,718	2019/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,694	408,252	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,190	3,202	353,894	2019/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,193	242,350	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	6,013	664,482	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,696	3,837	423,970	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,911	321,638	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,325	4,340	479,603	2019/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,230	356,925	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,204	2,218	245,173	2019/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,963	3,950	436,466	2020/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,427	2,405	265,769	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,722	632,259	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,763	3,531	390,241	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,788	2,786	307,901	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,809	1,812	200,266	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,792	2,790	308,269	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,895	319,873	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,810	642,010	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,035	4,182	462,162	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,607	2,603	287,687	2020/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,614	288,891	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,846	314,461	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,013	3,018	333,502	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,196	2,194	242,434	2018/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,001	3,016	333,238	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,872	317,390	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,189	2,181	240,991	2018/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,135	3,149	347,979	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,204	243,596	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,143	6,100	674,016	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,573	3,614	399,344	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	14	13	1,542	2018/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,457	271,582	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,868	2,857	315,719	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,179	2,173	240,107	2018/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,468	272,702	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,876	2,864	316,450	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,057	2,047	226,184	2018/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,906	652,617	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,116	3,101	342,644	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	3,843	424,691	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,568	283,845	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,138	2,138	236,272	2018/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,105	343,171	2020/11/30

外国債券インデックスマザーファンド

2017年6月5日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,687	2,714	299,923	2022/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,151	2,151	237,728	2018/12/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	3,064	338,608	2020/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,492	2,533	279,900	2022/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,146	2,141	236,656	2019/01/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,126	3,105	343,122	2021/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,366	5,155	569,636	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,065	2,047	226,261	2019/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,550	281,835	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,428	3,208	354,492	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,100	2,090	230,984	2019/03/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,309	3,254	359,640	2021/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,262	2,220	245,357	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,964	327,544	2021/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	2,082	230,078	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,905	1,890	208,911	2019/04/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,029	5,778	638,505	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,429	268,456	2021/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,042	225,729	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	3,201	353,741	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,507	2,487	274,843	2019/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	4,000	3,987	440,558	2018/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,675	295,593	2021/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,465	272,446	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,100	2,082	230,096	2019/06/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,000	993	109,811	2018/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,451	270,827	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,913	321,913	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,471	273,062	2019/07/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,600	5,297	585,338	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	3,078	340,133	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,470	272,932	2019/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,200	2,187	241,699	2018/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,621	400,154	2021/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	1,770	1,760	194,519	2018/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,623	400,411	2021/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,677	295,834	2023/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,327	257,114	2023/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,600	2,574	284,432	2019/09/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	3,000	2,981	329,408	2018/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,426	268,106	2023/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	2,974	328,652	2021/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,147	2,130	235,414	2019/10/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,326	2,310	255,262	2018/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,500	5,425	599,478	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,946	325,589	2021/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,457	271,562	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,650	3,690	407,760	2046/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,400	1,388	153,422	2019/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,000	996	110,105	2018/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,522	278,685	2023/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,400	2,408	266,085	2021/11/30	

2017年6月5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	1,440	1,440	159,210	2019/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	2,027	223,983	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,400	1,400	154,703	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,549	281,683	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,500	1,500	165,779	2020/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,700	1,696	187,429	2019/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,040	4,069	449,584	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,033	335,145	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,528	279,322	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,875	4,018	444,003	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,130	2,129	235,296	2020/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,300	2,294	253,539	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,033	335,222	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,325	256,965	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,900	1,911	211,234	2020/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,850	1,849	204,318	2019/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,000	5,054	558,444	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	900	906	100,170	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	850	852	94,140	2020/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,000	2,038	225,209	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	300	311	34,397	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	3,021	333,849	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	3,007	332,245	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	4,009	442,976	2020/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,004	331,987	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,996	441,593	2019/05/31
通貨小計	銘 柄 数 金 額	242銘柄		617,458	630,931	69,711,613	
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 401	32,865	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	386	623	51,003	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,429	116,989	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,745	142,905	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,192	1,793	146,778	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	969	1,003	82,117	2018/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,524	1,615	132,242	2019/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	1,872	153,276	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,476	1,595	130,578	2020/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	1,045	85,607	2021/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,351	1,469	120,299	2022/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,561	2,049	167,722	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,287	105,359	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,021	1,028	84,180	2018/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,535	125,653	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	853	868	71,127	2019/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,627	1,664	136,263	2019/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,047	1,225	100,316	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,247	102,133	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,719	1,754	143,585	2020/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	931	929	76,094	2020/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,129	1,148	94,027	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,237	1,233	100,933	2021/03/01

外国債券インデックスマザーファンド

2017年6月5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	0.7500	1,480	1,472	120,517	2021/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,344	1,341	109,817	2018/08/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,040	1,001	81,961	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,470	1,466	120,069	2018/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	840	823	67,413	2022/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,620	1,615	132,248	2019/02/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	900	901	73,749	2019/05/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	200	200	16,391	2022/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	460	460	37,676	2019/08/01	
通貨小計	銘柄数 金 額	32銘柄		35,945	39,852	3,261,905		
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル			
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.2500	2,455	2,612	214,318	2019/03/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,782	228,273	2021/05/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,409	2,599	213,235	2020/04/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,162	2,561	210,152	2022/07/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,462	202,014	2023/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,118	255,818	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,473	2,562	210,251	2024/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,314	1,404	115,209	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,398	2,565	210,438	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,108	1,347	110,563	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,197	1,224	100,459	2018/10/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,848	3,277	268,881	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,011	2,064	169,344	2019/10/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	863	951	78,034	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	557	538	44,206	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,195	2,194	180,059	2020/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	412	417	34,257	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,142	2,196	180,182	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,278	1,245	102,147	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	682	632	51,928	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	700	703	57,728	2021/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,200	1,224	100,432	2028/11/21	
通貨小計	銘柄数 金 額	22銘柄		37,481	40,686	3,337,940		
シンガポール				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル			
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	4.0000	491	508	40,667	2018/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	696	738	59,032	2020/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	867	69,384	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	470	37,618	2022/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.5000	599	614	49,105	2019/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	503	540	43,221	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	359	385	30,821	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	495	509	40,705	2021/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	427	34,211	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	491	518	41,464	2023/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	238	272	21,811	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	125	134	10,740	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	415	418	33,469	2019/10/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	124	127	10,218	2025/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	224	228	18,284	2020/07/01	

2017年6月5日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	SINGAPORE GOVERNMENT		国 債 証 券	2.7500	228	243	19,503	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国 債 証 券	2.1250	250	252	20,192	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国 債 証 券	1.2500	190	188	15,062	2021/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国 債 証 券	1.7500	200	201	16,125	2022/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国 債 証 券	2.2500	150	148	11,889	2036/08/01
通貨小計	銘 柄 数	額	20銘柄		7,388	7,797	623,529	
イギリス	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	2.0000	2,280	2,409	342,470	2020/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	2.0000	2,121	2,316	329,381	2025/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.5000	2,477	2,588	368,011	2021/01/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	2.5000	1,182	1,568	222,963	2065/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.5000	1,175	1,228	174,604	2026/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	0.5000	60	60	8,533	2022/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.5000	460	438	62,339	2047/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.7500	200	201	28,673	2037/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.7500	350	367	52,308	2057/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.2500	210	212	30,217	2027/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	8.0000	1,102	1,444	205,287	2021/06/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	6.0000	949	1,449	206,034	2028/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	1,590	2,189	311,271	2032/06/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	5.0000	1,472	1,942	276,159	2025/03/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	2,032	2,897	411,927	2036/03/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.7500	1,457	2,265	322,103	2038/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.7500	1,724	1,943	276,356	2020/03/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	1,708	3,017	428,922	2055/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	2,086	3,302	469,520	2046/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	1,232	1,624	230,871	2027/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.5000	1,666	2,620	372,547	2042/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.7500	1,590	2,264	321,963	2030/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	1,373	2,257	320,982	2049/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.5000	1,573	1,694	240,903	2019/03/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	1,246	1,830	260,205	2039/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.0000	1,232	1,444	205,370	2022/03/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.5000	1,870	2,701	384,004	2034/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	3.7500	1,428	1,545	219,772	2019/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.0000	1,244	2,190	311,427	2060/01/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	3.7500	1,795	2,004	285,007	2020/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	4.2500	1,577	2,346	333,611	2040/12/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	3.7500	1,633	1,873	266,296	2021/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	3.7500	1,352	2,118	301,216	2052/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.7500	2,242	2,391	340,013	2022/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	3.2500	2,156	2,839	403,595	2044/01/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.2500	2,854	2,889	410,836	2018/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	2.2500	1,942	2,137	303,903	2023/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	3.5000	1,621	2,747	390,575	2068/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.7500	2,251	2,329	331,138	2019/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	2.7500	1,842	2,105	299,330	2024/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	3.5000	2,124	2,939	417,865	2045/01/22
通貨小計	銘 柄 数	額	41銘柄		62,478	80,743	11,478,528	
スイス	SWISS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.0000	404	511	58,580	2023/02/11

外国債券インデックスマザーファンド

2017年6月5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		
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	千スイス・フラン 497	千スイス・フラン 721	千円 82,644	2028/04/08	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	517	556	63,781	2019/05/12	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	407	446	51,156	2020/07/06	
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	362	401	45,993	2021/04/28	
通貨小計	銘柄数 金 額	5銘柄		2,187	2,636	302,155		
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 19,421	325,116	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	8,601	9,542	159,743	2019/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	8,050	9,244	154,754	2021/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,326	89,158	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	8,363	9,424	157,773	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,164	3,202	53,611	2018/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,600	1,591	26,649	2027/11/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		46,136	57,754	966,808		
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千ノルウェー・クローネ 7,075	千ノルウェー・クローネ 7,615	99,914	2019/05/22	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,998	7,789	102,196	2021/05/25	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,824	5,072	66,547	2023/05/24	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,573	60,005	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,506	46,010	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,376	44,301	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,450	2,513	32,980	2027/02/17	
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		32,177	34,447	451,956		
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 10,849	138,874	2020/12/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	8,385	9,128	116,843	2019/03/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	5,789	74,104	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	10,033	128,430	2022/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,684	98,363	2023/11/13	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,895	6,951	88,979	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,680	5,986	76,624	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,950	2,993	38,318	2028/05/12	
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		51,650	59,417	760,540		
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 20,376	120,223	2019/12/11	
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	10,090	9,134	53,896	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	3,500	3,718	21,940	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	10,633	11,066	65,294	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	22,119	25,671	151,463	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	10,668	10,847	63,998	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,874	8,674	51,182	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	8,844	9,681	57,123	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	22,092	22,518	132,858	2018/12/13	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	9,694	10,765	63,514	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	14,128	14,438	85,189	2020/06/11	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	27,826	27,155	160,216	2021/06/10	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	13,465	79,445	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	13,099	12,708	74,981	2022/06/09	

2017年6月5日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	Mexican Bonos		国債証券	7.7500	千メキシコ・ペソ 14,654	千メキシコ・ペソ 15,094	千円 89,056	2042/11/13
	Mexican Bonos		国債証券	4.7500	16,633	16,237	95,799	2018/06/14
	Mexican Bonos		国債証券	7.7500	6,944	7,187	42,405	2034/11/23
通貨小計	銘 柄 数 金 額	17銘柄			232,260	238,743	1,408,588	
マレーシア	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	5.7340	千マレーシア・リンギット 647	千マレーシア・リンギット 677	17,543	2019/07/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.5020	573	545	14,118	2027/05/31
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	5.2480	738	811	21,020	2028/09/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.3780	1,603	1,638	42,418	2019/11/29
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.4980	1,178	1,192	30,879	2030/04/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.1600	1,916	1,953	50,572	2021/07/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.3920	1,514	1,554	40,255	2026/04/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.2320	650	639	16,554	2031/06/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.5800	895	899	23,275	2018/09/28
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.4180	875	863	22,343	2022/08/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8920	731	718	18,599	2027/03/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.1270	618	599	15,529	2032/04/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.4920	1,044	1,043	27,012	2020/03/31
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.4800	1,001	984	25,500	2023/03/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8440	477	451	11,679	2033/04/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.7330	586	560	14,506	2028/06/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8890	656	662	17,142	2020/07/31
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.9350	600	609	15,778	2043/09/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.1810	1,057	1,076	27,875	2024/07/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.0480	857	871	22,561	2021/09/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.6540	648	651	16,865	2019/10/31
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.9550	737	734	19,029	2025/09/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.6590	700	701	18,166	2020/10/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.7950	1,161	1,166	30,192	2022/09/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.2540	820	800	20,721	2035/05/31
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.7590	768	774	20,039	2019/03/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8000	702	700	18,126	2023/08/17
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.7360	630	629	16,286	2046/03/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.9000	50	49	1,292	2026/11/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.6200	352	351	9,102	2021/11/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8820	500	506	13,119	2022/03/10
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.0590	600	608	15,753	2024/09/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8990	350	350	9,072	2027/11/16
通貨小計	銘 柄 数 金 額	33銘柄			26,234	26,378	682,936	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.0000	千南アフリカ・ランド 4,178	千南アフリカ・ランド 4,220	36,295	2018/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	7.2500	5,768	5,756	49,501	2020/01/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	10.5000	15,434	17,471	150,253	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	6.2500	7,612	5,582	48,010	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	6.7500	4,622	4,512	38,809	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	6.5000	8,904	6,426	55,265	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	7.0000	8,999	7,615	65,497	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	7.7500	5,539	5,517	47,447	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.7500	13,452	12,423	106,845	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.5000	8,621	7,951	68,382	2037/01/31

外国債券インデックスマザーファンド

2017年6月5日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.0000	千南アフリカ・ランド 8,862	千南アフリカ・ランド 8,242	千円 70,887	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.7500	6,944	6,408	55,111	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.2500	6,243	5,825	50,095	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.8750	4,166	4,015	34,530	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	9.0000	2,179	2,080	17,888	2040/01/31
通貨小計	銘 柄 数 金 額	15銘柄			111,523	104,048	894,821	
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 2,659	79,153	2022/09/23
	Poland Government Bond		国 債 証 券	5.5000	1,912	2,066	61,499	2019/10/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	1.5000	2,478	2,437	72,535	2020/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.5000	3,377	3,226	96,012	2026/07/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.0000	2,127	2,097	62,413	2021/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	-	2,758	2,693	80,153	2018/10/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	1.7500	3,051	2,970	88,400	2021/07/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.5000	1,820	1,716	51,089	2027/07/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.2500	1,620	1,595	47,478	2022/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	-	400	386	11,489	2019/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	5.7500	827	1,042	31,017	2029/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	5.2500	2,256	2,474	73,637	2020/10/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	5.7500	884	1,003	29,867	2021/10/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	4.0000	2,575	2,756	82,038	2023/10/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.5000	2,099	2,121	63,147	2018/07/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	3.2500	1,840	1,891	56,286	2019/07/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	3.2500	2,591	2,639	78,544	2025/07/25
通貨小計	銘 柄 数 金 額	17銘柄			34,924	35,778	1,064,765	
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY		国 債 証 券	4.5000	千ユーロ 759	千ユーロ 810	100,970	2018/10/18
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	4.4000	684	752	93,742	2019/06/18
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	5.9000	570	656	81,755	2019/10/18
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	5.4000	1,131	1,551	193,240	2025/03/13
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	5.0000	765	904	112,683	2020/10/18
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	3.9000	504	616	76,791	2023/03/20
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	3.4000	607	733	91,381	2024/03/18
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	2.4000	761	866	107,863	2030/05/15
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	0.8000	516	539	67,144	2022/03/15
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	2.0000	531	538	67,091	2045/02/18
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	1.0000	673	687	85,634	2026/05/15
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	1.7000	350	351	43,745	2037/05/15
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	4.5000	1,035	1,181	147,201	2020/04/18
国 小 計	銘 柄 数 金 額	13銘柄			8,886	10,191	1,269,245	
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 789	98,275	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	5.5000	1,239	1,890	235,421	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.0000	1,355	2,113	263,175	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.7500	791	971	120,937	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.0000	1,544	1,625	202,423	2018/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.0000	1,347	1,481	184,527	2019/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.5000	1,146	1,295	161,303	2020/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.7500	1,349	2,134	265,843	2042/01/15

2017年6月5日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,463	1,692	210,824	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,631	203,149	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,466	182,616	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,548	192,905	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	924	953	118,738	2019/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,084	1,510	188,086	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,730	215,499	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,374	1,407	175,322	2020/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,291	1,299	161,863	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,338	1,359	169,319	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	400	407	50,724	2022/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	500	513	63,898	2027/07/15
国小計	銘柄数 金額	20銘柄		23,198	27,821	3,464,855	
ユーロ (ベルギー)				千ユーロ	千ユーロ		
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,455	181,266	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	924	921	114,787	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	558	612	76,225	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,283	1,344	167,425	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	544	533	66,423	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	290	305	38,026	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	150	152	18,958	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	600	609	75,897	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	250	255	31,866	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	260	285	35,500	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	300	304	37,879	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,584	321,821	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,768	344,779	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	1,377	1,668	207,739	2022/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	1,121	1,215	151,370	2019/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	1,736	1,984	247,126	2020/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,674	2,622	326,590	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,739	216,674	2021/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,364	169,902	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,634	203,512	2022/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	680	961	119,785	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	1,123	1,217	151,586	2019/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,532	190,874	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	1,052	1,072	133,580	2018/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	753	1,118	139,301	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,770	220,480	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	597	769	95,806	2034/06/22
国小計	銘柄数 金額	27銘柄		26,687	32,802	4,085,191	
ユーロ (フランス)				千ユーロ	千ユーロ		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	653	795	99,121	2019/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	985	1,486	185,189	2023/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,225	3,273	407,716	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,623	4,007	499,100	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,007	4,980	620,229	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,709	4,222	525,919	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,075	3,358	418,284	2019/04/25

外国債券インデックスマザーファンド

2017年6月5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	4.0000	1,564	2,474	308,133	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	3,230	3,759	468,263	2021/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	2,424	3,568	444,450	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2500	3,697	4,704	585,945	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2500	2,567	2,740	341,315	2018/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.5000	2,734	4,348	541,539	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	3,263	3,604	448,901	2019/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.5000	3,380	3,776	470,376	2020/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	1,017	1,642	204,608	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.5000	3,146	3,976	495,285	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	3,113	3,430	427,257	2020/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	3,550	4,114	512,444	2021/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.0000	3,630	4,211	524,544	2022/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	3,099	3,722	463,644	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	2,694	3,045	379,254	2022/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	2,088	2,806	349,529	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	3,347	3,709	462,032	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	1,920	1,964	244,695	2018/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	3,086	3,543	441,245	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	2,264	2,335	290,828	2019/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	2,787	3,300	411,010	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	2,799	3,115	387,984	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	2,322	2,383	296,891	2019/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	2,792	2,827	352,176	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	3,070	3,118	388,321	2020/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	2,101	2,200	274,089	2025/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	2,193	2,247	279,916	2020/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	2,720	2,866	357,037	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,592	1,608	200,311	2019/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	2,737	2,728	339,764	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2500	1,079	1,051	130,965	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	587	550	68,573	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	2,170	2,203	274,427	2021/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	2,400	2,316	288,440	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,100	1,111	138,439	2022/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	620	647	80,667	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	700	710	88,498	2020/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	900	925	115,243	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	800	837	104,284	2048/05/25
国小計	銘 柄 数	46銘柄			106,559	126,360	15,736,904	
ユーロ (ドイツ)					千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	6.2500	1,174	1,675	208,689	2024/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	6.5000	1,567	2,542	316,651	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	5.6250	1,362	2,116	263,593	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	950	1,402	174,643	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	6.2500	951	1,624	202,278	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	5.5000	1,448	2,389	297,583	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	1,775	2,927	364,602	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	2,071	3,254	405,363	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2500	1,225	2,042	254,379	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2500	2,211	2,332	290,491	2018/07/04

2017年6月5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	
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	1,399	2,506	312,099	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	2,682	2,875	358,082	2019/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.5000	2,481	2,701	336,480	2019/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	2,075	2,290	285,239	2020/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.0000	1,928	2,150	267,817	2020/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	1,474	2,197	273,714	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	1,444	1,582	197,060	2020/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	2,333	2,597	323,552	2021/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	1,674	1,939	241,549	2021/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	1,415	1,586	197,610	2021/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	1,707	1,906	237,454	2022/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	2,222	2,469	307,605	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	1,728	2,294	285,773	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	1,644	1,809	225,363	2022/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	1,410	1,558	194,058	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	1,817	2,012	250,619	2023/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	1,599	1,824	227,255	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,561	1,765	219,917	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	1,959	2,626	327,095	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	1,594	1,778	221,467	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	1,542	1,667	207,624	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	2,394	2,496	310,909	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	1,534	1,657	206,404	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	2,168	2,243	279,420	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	2,850	2,800	348,816	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	1,000	997	124,275	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,500	1,512	188,306	2018/06/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	700	707	88,063	2018/09/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	950	961	119,706	2018/12/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	400	405	50,489	2019/03/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	400	405	50,555	2019/06/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	1,209	1,238	154,275	2018/10/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	1,438	1,481	184,543	2019/02/22
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	1,113	1,139	141,874	2019/04/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	1,151	1,177	146,655	2019/10/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,731	1,766	220,023	2020/04/17
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	1,448	1,492	185,864	2020/10/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,578	1,614	201,054	2021/04/09
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,700	1,740	216,701	2021/10/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国債証券	-	360	367	45,824	2022/04/08
国小計	銘	50銘柄			78,046	92,656	11,539,485	
	金 額				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (スペイン)	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	6.0000	1,952	2,823	351,639	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.6000	1,745	1,804	224,696	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.9500	1,552	1,548	192,866	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.1500	1,792	1,912	238,195	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.1500	1,250	1,299	161,783	2020/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.9500	1,733	1,815	226,135	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	1,672	1,686	209,988	2019/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	1,147	1,179	146,834	2021/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.9000	852	852	106,192	2046/10/31

外国債券インデックスマザーファンド

2017年6月5日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.4500	400	419	52,187	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.3000	1,730	1,708	212,782	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.4000	580	582	72,489	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	1,800	1,789	222,862	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.3500	550	554	69,069	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.7500	1,979	2,910	362,524	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2000	1,654	2,094	260,825	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.9000	1,428	1,976	246,111	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.1000	2,206	2,318	288,790	2018/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.8000	1,682	2,115	263,510	2024/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.6000	2,382	2,629	327,461	2019/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.3000	1,775	1,966	244,857	2019/10/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7000	1,373	1,859	231,636	2041/07/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	2,101	2,351	292,848	2020/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.6500	1,789	2,265	282,147	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.8500	1,681	1,959	244,049	2020/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.5000	2,515	3,051	380,046	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.9000	1,965	2,721	338,879	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.8500	1,978	2,493	310,479	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.4000	2,608	3,319	413,379	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.4000	1,601	1,970	245,403	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.1500	1,270	1,716	213,761	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	1,754	1,856	231,217	2018/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.1500	1,049	1,505	187,524	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,836	1,942	241,869	2019/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.8000	1,970	2,351	292,808	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	2,097	2,352	293,003	2024/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.4000	1,900	1,979	246,554	2020/01/31
国小計	銘柄数 金 額	37銘柄			61,348	71,683	8,927,417	
ユーロ (イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	9.0000	1,106	1,618	201,527	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	7.2500	1,110	1,600	199,320	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	6.5000	2,392	3,325	414,193	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	1,814	1,908	237,730	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0500	1,445	1,476	183,914	2019/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	1,429	1,410	175,618	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.3500	1,629	1,663	207,170	2022/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	1,687	1,644	204,772	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.6500	1,765	1,566	195,110	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7000	1,511	1,529	190,515	2020/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	1,591	1,597	198,965	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.4500	1,504	1,535	191,196	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.3000	1,171	1,178	146,804	2018/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.6500	774	781	97,326	2020/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7000	1,440	1,264	157,539	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.9500	1,259	1,242	154,799	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.6000	1,286	1,239	154,328	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.1000	812	814	101,451	2019/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.4500	1,674	1,667	207,689	2021/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	924	839	104,531	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2500	1,568	1,454	181,169	2026/12/01

外国債券インデックスマザーファンド

2017年6月5日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	700	669	83,324	2023/10/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,337	166,595	2021/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	448	369	46,013	2067/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	858	856	106,655	2019/10/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	900	862	107,449	2033/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,060	1,056	131,514	2027/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	304	37,935	2024/05/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	350	354	44,170	2022/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	120	120	14,957	2020/06/15	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,654	3,425	426,564	2029/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,963	493,561	2031/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,455	2,004	249,638	2033/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,074	2,222	276,784	2019/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,921	2,139	266,400	2020/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,098	2,700	336,325	2034/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,890	3,334	415,233	2037/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	3,085	384,289	2021/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,734	2,240	279,025	2039/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,710	337,570	2023/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,187	2,306	287,267	2018/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,708	2,922	364,008	2019/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,531	2,767	344,701	2019/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,608	324,855	2025/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,043	2,614	325,560	2040/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,560	2,841	353,889	2020/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,214	2,475	308,265	2020/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,484	309,372	2026/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,405	299,581	2021/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,671	332,655	2021/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,395	298,371	2022/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	2,036	253,566	2022/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,910	2,348	292,539	2022/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,810	2,224	277,031	2028/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,242	279,322	2023/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,770	1,837	228,799	2018/06/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,363	1,696	211,229	2044/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,607	324,746	2024/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,111	2,224	277,079	2018/12/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,729	1,942	241,914	2021/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.5000	1,100	1,153	143,606	2019/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,507	312,282	2024/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,938	2,135	265,943	2030/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,692	210,795	2021/12/15	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	1.5000	1,246	1,285	160,057	2019/08/01	
国小計	銘柄数 金額	65銘柄			108,029	121,544	15,137,131	
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国債証券	0.3750	432	444	55,389	2020/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	411	51,291	2031/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	293	36,602	2025/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	411	417	51,992	2026/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	-	200	200	24,988	2023/09/15	

外国債券インデックスマザーファンド

2017年6月5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		
	Finland Government Bond	国債証券	-	270	273	34,116	2022/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	4.3750	416	459	57,260	2019/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	874	108,884	2025/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	3.3750	632	704	87,697	2020/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	3.5000	459	529	65,979	2021/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	481	60,018	2028/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	612	672	83,780	2022/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	489	60,966	2023/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	538	67,092	2042/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	425	435	54,178	2018/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	601	74,899	2024/04/15	
国小計	銘柄数 金 額	16銘柄		6,988	7,829	975,136		
ユーロ (オーストリア)				千ユーロ	千ユーロ			
	Austria Government Bond	国債証券	0.2500	527	537	66,985	2019/10/18	
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	939	117,060	2025/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	576	591	73,687	2026/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	234	235	29,300	2047/02/20	
	Austria Government Bond	国債証券	-	300	301	37,553	2023/07/15	
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	380	377	47,069	2027/04/20	
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	985	1,557	193,909	2027/07/15	
	Austria Government Bond	国債証券	3.9000	1,248	1,421	177,051	2020/07/15	
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,563	194,695	2021/09/15	
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,073	1,643	204,693	2037/03/15	
	Austria Government Bond	国債証券	4.3500	989	1,077	134,135	2019/03/15	
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,223	152,322	2026/03/15	
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	951	118,559	2022/04/20	
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	1,045	130,205	2022/11/22	
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	318	538	67,104	2062/01/26	
	Austria Government Bond	国債証券	1.9500	738	776	96,749	2019/06/18	
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	872	108,626	2044/06/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,071	133,469	2023/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	621	754	93,913	2034/05/23	
	Austria Government Bond	国債証券	1.1500	426	436	54,355	2018/10/19	
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,036	129,145	2024/10/21	
国小計	銘柄数 金 額	21銘柄		15,683	18,954	2,360,597		
通貨小計	銘柄数 金 額	295銘柄		435,424	509,843	63,495,967		
合 計	銘柄数 金 額	761銘柄				158,442,056		

(注1) 邦貨換算金額は、2017年6月5日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第28期 (決算日 2016年9月20日)

(計算期間 2015年9月25日～2016年9月20日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

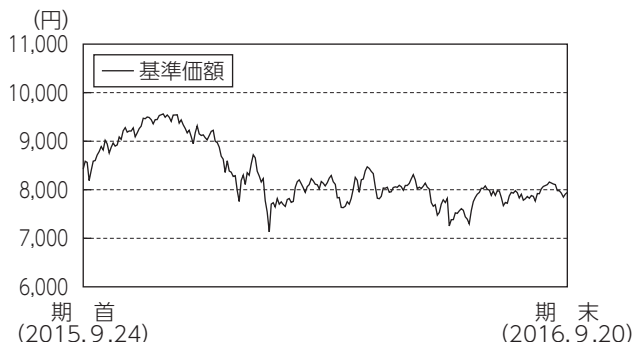
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



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

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：8,429円 期末：7,944円 騰落率：△5.8%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、世界経済の先行き不透明感や円高の進行などで下落しましたが、2015年10月に入ると、世界経済に対する過度な不安感が後退したことやE C B（欧州中央銀行）が追加金融緩和を示唆したこと、中国が追加金融緩和を実施したことなどで上昇しました。12月以降は、E C Bの追加金融緩和策への失望や原油価格の下落、中国・人民元安と中国株安、円高などにより株価は下落しました。2016年1月末には、日銀がマイナス金利を導入し一時的に株価は上昇しましたが、その後は米国経済および中国経済への懸念や欧州金融機関への信用不安などで下落しました。2

月後半からは、米国の製造業関連指標の回復や中国およびE C Bの金融緩和などにより株価は反発しましたが、3月後半以降は、日米金融政策や米国為替政策への思惑から為替相場が不安定になり、株価も乱高下しました。6月には、英国の国民投票でE U（欧州連合）離脱支持が多数だったことを受けて株価は下落しましたが、7月以降は、国内の財政・金融政策への期待や円高傾向の一般などから上昇しました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

・その他、ファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの騰落率と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まいります。

■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2015年9月25日から2016年9月20日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2015年9月25日から2016年9月20日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 株式先物取引	百万円 14,012	百万円 14,792	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2015年9月25日から2016年9月20日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘	柄	株 数	金 額	平均単価	銘	柄	株 数	金 額	平均単価
		千株	千円	円			千株	千円	円
日本郵政		184.2	328,647	1,784	トヨタ自動車		88.38	652,407	7,381
ゆうちょ銀行		153.2	250,353	1,634	日本たばこ産業		24.3	99,651	4,100
ソフトバンクグループ		33.9	213,547	6,299	富士重工業		16.2	75,877	4,683
トヨタ自動車		30.9	189,326	6,127	パナソニック		54.5	74,892	1,374
三井住友フィナンシャルG		42	176,060	4,191	KDDI		21.7	66,764	3,076
リクルートホールディングス		36.6	139,821	3,820	ファーストリテイリング		2	63,595	31,797
武田薬品		22.1	123,151	5,572	野村ホールディングス		74.6	56,817	761
三菱UFJフィナンシャルG		198.7	106,140	534	日本電信電話		12.1	55,655	4,599
日本電信電話		18.6	90,231	4,851	スズキ		16.6	53,249	3,207
日立		131	81,949	625	花王		9	51,733	5,748

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首			期末			銘柄	期首			期末			銘柄	期首			期末		
	株数	株数	千円	株数	株数	千円		株数	株数	千円	株数	株数	千円		株数	株数	千円	株数	株数	千円
水産・農林業 (0.1%)							ユアテック						ハウス食品G本社							
極洋	37	35	9,485				千株	千株	千円	千株	千円	千株	千円	23.1	21.9	49,187				
日本水産	86.2	77.9	34,509				中電工	9.7	7.5	14,865			カゴメ	21	23.1	57,495				
マルハニチロ	15.3	14	34,692				関電工	29	26	23,842			アリアケジャパン	6.1	5.6	29,400				
サカタのタネ	11	10.7	27,552				きんでん	40.7	35.1	39,768			ニチレイ	71	71	75,331				
ホクト	7.5	7	12,558				東京エネシス	6	8	7,624			東洋水産	32.6	31.5	136,552				
鉱業 (0.3%)							トーエネック	12	11	5,225			日清食品HD	26.5	27.2	165,376				
日鉄鉱業	23	20	7,760				住友電設	6.1	6	6,210			永谷園ホールディングス	8	8	10,080				
三井松島	66	57	6,840				日本電設工業	10.6	9.9	17,641			一正浦鉾	0.4	-	-				
国際石油開発帝石	333.5	338.9	280,168				協和エクスオ	26.7	25.3	36,583			フジッコ	7	6.9	14,959				
日本海洋掘削	2.2	2.5	5,552				九電工	12	12.2	41,236			ロックフィールド	4.2	8.4	11,944				
石油資源開発	9.1	10.2	21,205				三機工業	13.9	14.3	11,954			日本たばこ産業	375.6	361.7	1,434,502				
K&Oエナジーグループ	5.2	5.1	7,007				日揮	64	65	109,785			わらべや日洋HD	4.4	4.1	8,122				
建設業 (3.1%)							中外炬工業	28	34	6,766			ユーグレナ	21	22.5	32,625				
ショーボンドHD	6	6.8	31,042				太平電業	10	10	9,590			ミヨシ油脂	48	95	11,875				
ミライト・ホールディングス	20.7	20.4	17,748				高砂熱学	17.7	18.6	27,583			繊維製品 (0.8%)							
安藤・間	44.4	44.7	27,267				明星工業	14	13.9	6,463			片倉工業	9.2	8.9	10,306				
東急建設	23.9	22	21,538				大気社	9.5	7.4	18,352			グンゼ	50	49	15,337				
コムシスホールディングス	28.5	27.1	49,836				ダイダイン	11	10	7,830			東洋紡	253	244	40,016				
ミサワホーム	9.5	8.9	6,764				日比谷総合設備	9	8.6	14,052			エニチカ	235	233	13,048				
髙松コストラクションGP	5.3	4.8	11,092				東芝プラントシステム	10.1	9.9	15,780			富士紡ホールディングス	36	37	10,508				
東建コーポレーション	2.7	2.8	20,888				東洋エンジニア	33	35	10,885			日清紡ホールディングス	40	-	-				
大成建設	328	340	258,400				千代田化工建	46	47	37,506			倉敷紡績	72	58	10,556				
大林組	190	196	193,256				新興プランテック	14.4	13.5	9,517			シキボウ	69	121	13,068				
清水建設	193	199	177,110				食品 (4.9%)					日本毛織	20	18.6	12,982					
飛鳥建設	46.7	62	10,726				日本製粉	39	43	32,379			ダイドーリミテッド	15.6	14.7	6,012				
長谷工コーポレーション	79.8	76.8	71,961				日清製粉G本社	70	71	107,352			帝国繊維	7.3	7	9,660				
松井建設	11	10.3	11,433				昭和産業	30	27	13,986			帝人	246	248	97,712				
銭高組	7	18	6,246				中部飼料	4.8	8.5	6,069			東レ	456	439	422,625				
鹿島建設	277	306	213,588				フィード・ワン	61.9	54.7	6,235			サカイ オーベックス	-	58	11,136				
不動テトラ	52.8	51.3	8,669				日本甜菜糖	49	49	9,408			住江織物	24	37	8,251				
鉄建建設	42	43	13,416				三井製糖	29	28	13,020			日本バイリーン	13	-	-				
西松建設	70	75	34,350				森永製菓	62	61	54,717			芦森工業	90	89	9,434				
三井住友建設	264	255.1	24,744				中村屋	23	23	10,373			アツギ	17	16.1	18,756				
大豊建設	19	27	14,553				江崎グリコ	14.7	15.1	82,899			セーレン	17	13.2	8,448				
前田建設	43	40	33,360				不二家	43	51	10,200			小松精練	15.7	13.2	8,448				
オカノフード建設	3.5	15.2	5,973				山崎製パン	46	48.4	119,257			ワコールホールディングス	34	33	36,399				
奥村組	60	58	32,422				ヤクルト	4	4	5,500			ホクメディカル	3.8	3.8	27,398				
東鉄工業	8.1	8	22,392				モロゾフ	24	21	9,051			T S Iホールディングス	28.2	27.6	15,538				
浅沼組	17	37	7,992				亀田製菓	3.8	3.9	20,436			三陽商会	39	37	5,883				
戸田建設	80	76	39,140				寿スピリッツ	2.2	5.7	13,149			オンワードホールディングス	42	36	24,732				
熊谷組	83	97	25,608				カルビー	23.4	24.1	91,459			ゴールドウイン	16	28	14,700				
北野建設	20	33	8,415				森永乳業	60	59	44,368			デサント	14.9	14.4	17,668				
三井ホーム	16	13	5,954				六甲バター	1.7	4	11,488			パルプ・紙 (0.3%)							
矢作建設	10.7	10.1	9,059				ヤクルト	33.9	35.3	167,498			特種東海製紙	40	38	12,692				
ピーエス三菱	-	20.3	7,064				明治ホールディングス	18.7	39.4	376,664			王子ホールディングス	243	229	92,516				
日本ハウスHLDGS	14.1	27.2	10,390				雪印メグミルク	15.4	15.7	54,243			日本製紙	29.4	31.2	57,876				
大東建託	23.3	24.4	390,278				プリマハム	41	46	16,376			三菱製紙	121	111	7,548				
新日本建設	4.7	10.7	9,416				日本ハム	47	47	113,975			北越紀州製紙	40.6	39.5	24,608				
N I P P O	14	15	28,605				伊藤ハム	36	-	-			中越パルプ	28	30	6,750				
東亜道路	16	27	6,831				丸大食品	37	36	17,280			大王製紙	27	27.2	32,504				
前田道路	20	19	34,276				米久	1.4	-	-			レンゴー	52	53	33,125				
日本道路	21	20	7,860				S Foods	4.9	4.6	12,084			トーモク	27	24	6,600				
東亜建設	53	61	10,797				伊藤ハム米久HLDGS	-	41.9	42,360			ザ・バック	4.9	4.7	12,064				
若築建設	44	92	13,248				サッポロホールディングス	108	20.2	55,388			化学 (6.4%)							
東洋建設	20.6	22.4	9,497				アサヒグループホールディングス	118.9	122.7	436,443			クラレ	92.4	94.8	134,900				
五洋建設	72.4	73.1	39,766				キリンHD	256.4	281	457,889			旭化成	369	378	302,173				
大林道路	9	9.1	5,651				宝ホールディングス	51.9	47.3	44,083			共和レザー	-	6.3	4,794				
世紀東急	12.3	13.3	6,809				オノンホールディングス	35	60	13,200			昭和電工	410	40.8	51,122				
福田組	11	12	12,468				コカ・コーラウエスト	21.1	22.1	55,338			住友化学	435	445	203,810				
住友林業	47	44.6	59,808				コカ・コーラ・ストゾガパン	22.1	23.2	45,286			住友精化	14	14	9,506				
日本基礎技術	5.2	26.2	8,515				サントリー食品インター	42.8	45.5	192,010			日産化学	39	36.7	113,586				
日成ビルド工業	24	22	10,208				ダイドードリンク	3.2	3.4	18,564			ラサ工業	-	41	4,264				
ヤマダ・エスバイホーム	52	-	-				伊藤園	18.4	19.3	65,330			クレハ	43	45	16,515				
パコーポレーション	14.7	-	-				キーコービー	6.4	6.7	12,750			テイカ	15	14	7,182				
バナース	25	25	19,600				日清オイログループ	35	36	16,488			石原産業	113	120	7,920				
大和ハウス	186.9	193	513,283				不二製油グループ	17.1	17.5	34,790			日東エフシー	-	5.8	4,645				
ライト工業	11.2	13.4	15,624				J-オイルミルズ	33	32	11,296			日本曹達	41	41	17,302				
積水ハウス	199	217.3	363,434				キッコマン	52	49	156,800			東ソノ	156	164	100,860				
日特建設	11.2	18.6	8,872				味の素	146	138.1	307,134			トクヤマ	101	110	38,060				
							キユーピー	32	33.9	102,039			セントラル硝子	63	66	26,004				
													東亜合成	35.8	37.2	39,097				

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	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		
住友電工	222.7	241.1	347,063	クボタ	284	293.8	430,710	富士電機	156	175	79,800									
フジクラ	86	84	46,872	三菱化工機	24	34	7,208	東洋電機製造	16	38	11,780									
昭和電線HLDGS	85	98	6,664	月島機械	11.8	11.8	12,413	安川電機	69.7	72.2	107,794									
タツタ電線	12.6	16.7	5,794	帝国電機製作所	5.5	8	6,328	シフオニア テクノロジー	46	47	7,802									
リョービ	39	39	16,965	新東工業	15.5	14.6	12,074	明電舎	59	56	18,424									
アールステイ	7.5	9.4	9,672	渋谷工業	5.5	5.5	9,955	山洋電気	14	17	9,265									
アサヒHD	9.6	9.4	16,384	アイチ コーポレーション	11.6	10	7,090	デンヨー	5.7	6.2	6,175									
金属製品 (0.6%)				小森コーポレーション	15.3	15.2	19,273	東芝テック	42	43	17,028									
稲葉製作所	1.5	4.5	5,530	鶴見製作所	5.3	5.1	7,507	マブチモーター	16.1	16.6	87,814									
宮地エンジニアリング	11	56	7,952	住友精密	14	21	6,552	日本電産	62.5	70.8	633,447									
トーカロ	4.6	5.3	11,803	荏原製作所	124	135	74,790	東光高岳	3	3.4	6,732									
SUMCO	45.7	48.4	40,162	西島製作所	7.7	7.7	7,915	ダブル・スコープ	-	5.6	11,922									
川田テクノロジーズ	1.5	1.5	6,675	北越工業	5.9	14.3	9,295	ダイヘン	33	35	18,480									
東洋製罐グループHD	42.3	41.1	75,624	ダイキン工業	82.4	85	796,280	田淵電機	5.9	16.2	5,475									
ホクサンホールディングス	24	20	6,860	オルガン	15	14	5,670	JVCケンウッド	45.5	47.7	11,829									
横河リッツHLDGS	12.3	12.4	13,416	トーヨーカネツ	42	42	8,526	ミマキエンジニアリング	2	-	-									
三和ホールディングス	57.1	61.4	58,084	栗田工業	32.3	35.2	80,537	第一精工	2.5	3.8	3,689									
文化シャツター	19	18.2	13,650	椿本チエイン	31	34	26,146	日新電機	15	14.6	23,827									
三協立山	8.4	8.3	13,097	日本コンベヤ	25	-	-	大崎電気	11	12	11,700									
アルインコ	-	6.8	6,120	アナスト岩田	12.2	11.6	11,565	オムロン	60.4	65.7	237,834									
LEXILグループ	87.1	83.2	180,211	ダイフク	28.8	31.2	54,350	日東工業	9.3	9.6	12,873									
ノーリツ	11.8	11.8	24,083	加藤製作所	14	21	8,610	IDEC	8.5	9.3	8,593									
長府製作所	6.5	5.9	15,198	油研工業	-	54	9,072	ジューエス・ユアサ コーポ	113	114	47,196									
リンナイ	10.9	11.2	102,256	タダノ	28	28	25,648	サクサホールディングス	9	-	-									
岡部	13.2	13.7	11,343	フジテック	17.2	17	19,329	メルコホールディングス	4	4.2	10,802									
ジーテクト	4	7.3	13,329	CKD	16.8	17.3	20,344	日本電気	729	797	204,829									
東プレ	12.4	12.2	24,766	キトー	7.8	9.3	8,332	富士通	544	560	300,272									
高周波熱練	12.4	12.8	9,241	平和	18.5	18	41,202	沖電気	209	260	35,880									
東京製綱	50	49	7,938	理想科学工業	7.5	6.7	10,867	電気興業	20	19	9,443									
パイオラックス	3.4	3.3	19,833	SANKYO	15.5	15.3	53,091	サンケン電気	31	36	11,412									
日本発条	51.5	53.3	51,381	日本金銭機械	6.1	6.7	9,279	アイホン	4.4	4.1	6,535									
三益半導体	6.5	5.5	6,319	マースエンジニアリング	4.7	3.9	7,683	ルネサスエレクトロニクス	28.9	33	20,427									
機械 (5.0%)				福島工業	3.9	4.2	13,398	セイコーエプソン	76.5	86.2	163,780									
日本製鋼所	86	102	47,532	ダイコク電機	3.5	3.4	5,168	ワコム	48	48.4	15,052									
三浦工業	25.5	27.2	54,073	竹内製作所	6.3	12.2	17,019	アルバック	9.9	10.9	31,588									
タクマ	20	23	21,045	アマノ	19.8	18	28,404	アクセル	4.5	4.9	3,547									
ツガミ	19	20	10,460	JUKI	9.4	10.4	7,280	EIZO	5.7	6.1	16,012									
オーコム	40	40	30,240	サンデンホールディングス	38	37	10,767	ジャパンディスプレイ	114.7	110.1	18,276									
東芝機械	35	34	11,254	蛇の目マシン	67	12	6,552	日本信号	16.1	16.6	13,612									
アマダホールディングス	89	85.8	91,634	マックス	10	10	11,540	京三製作所	17	19	7,011									
アイダエンジニア	14.3	16.9	13,148	グローリー	18.1	19.7	64,616	能美防災	8	7.1	10,224									
滝澤鉄工所	29	81	10,692	新晃工業	5.3	5.3	6,799	ホーチキ	2.6	5.6	5,964									
富士機械製造	20.2	17.9	20,495	大和冷機工業	9.9	10.8	9,622	エレコム	2.5	5.9	12,443									
牧野フライス	31	31	19,158	セガミホールディングス	60.8	60.9	86,782	日本無線	16	21	5,649									
オーエスジー	27.3	27.4	52,799	日本ビストンリング	34	7.5	11,227	パナソニック	693.6	666.3	678,293									
旭ダイヤモンド	17.3	17.2	14,035	リケン	30	31	10,416	シャープ	479	-	-									
DMG森精機	38.3	33.9	34,510	T P R	7	7.5	20,655	アンリツ	34	34.6	19,583									
ソデック	10.4	15.3	11,061	ホシザキ	12.3	12.9	112,746	富士通ゼネラル	18	18	36,954									
ディスコ	7.1	7.7	91,630	大豊工業	6.6	6	6,708	日立国際電気	16	14	25,494									
日東工器	4.1	4.1	9,290	日本精工	117.1	118.7	124,397	ソニー	397.6	412.5	1,369,500									
OKK	-	4.2	4,158	N T N	134	145	51,765	TDK	34.1	34.9	251,629									
島精機製作所	9.1	8.8	22,290	ジェイテクト	60.6	59.8	88,563	帝国通信工業	-	4.6	6,854									
NCホールディングス	-	3.2	2,672	不二越	54	54	19,170	ミツミ電機	22	24.9	14,367									
日版製作所	9.4	9.4	7,444	日本トムソン	22	22	8,250	タムラ製作所	26	27	10,098									
やまびこ	2.7	12.1	9,934	T H K	37.4	37.9	72,957	アルプス電気	46	50.7	124,975									
ナプテスコ	36.1	31.2	86,486	ユーシン精機	3.2	3.1	7,272	パイオニア	92.4	97.4	21,622									
三井海洋開発	6.1	7.4	12,143	イーグル工業	8.8	7.7	9,871	日本電波工業	7.7	8.1	6,650									
S M C	17.7	18.2	520,338	日本ビラール工業	8.5	7.5	7,005	日本トリム	1.1	1.9	10,944									
新川	4.4	11.5	7,348	キッツ	27.3	29.2	16,030	ロランド ディー・ジー	2.8	3.6	8,154									
ホンカワマイクロ	14	12	6,828	日立工機	15.4	7.2	5,133	フオスター電機	6.4	7.7	14,753									
ユニオンツール	3.1	2.9	7,571	マキタ	36.7	37.5	267,000	クラリオン	34	34	10,234									
オイレス工業	7.5	7.7	12,681	日立造船	48.7	46.7	24,003	S M K	20	22	7,370									
日精工エースビー	2.6	2.8	4,494	三菱重工業	948	1,032	448,300	ヨコオ	-	8.1	4,900									
サトーホールディングス	7.8	8.4	18,001	I H I	407	446	126,218	東光	19	-	-									
日精油脂工業	5.5	7.2	4,845	電気機器 (12.3%)				ホシデン	18.7	19.6	14,974									
小松製作所	290.2	299.1	684,490	日清防ホールディングス	-	30.2	30,864	ヒロセ電機	9.5	9.2	119,324									
住友重機械	163	176	88,704	イビデン	36.6	36.1	47,471	日本航空電子	17	17	26,656									
日立建機	26.9	26.7	52,839	コニカミノルタ	132.2	144.5	125,137	T O A	7.4	7.9	7,102									
巴工業	3.8	3.8	5,779	ブラザー工業	72.4	73.9	126,812	日立マクセル	10.1	9.8	15,346									
井関農機	65	66	16,302	ミネベア	85	94	89,018	古野電気	9	10.1	5,423									
T O W A	3.2	8	9,536	日立	1,358	1,482	701,578	ユニデンホールディングス	26	94	14,194									
丸山製作所	-	27	4,509	東芝	1,189	1,240	391,840	アルパイン	14.2	14.4	17,049									
北川鉄工所	33	47	7,802	三菱電機	566	619	775,916	スミダコーポレーション	8.2	-	-									

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
日鉄住金物産	千株 34	千株 47	千円 16,826	サイゼリヤ	千株 8.9	千株 9.8	千円 22,383	三井住友トラストHD	千株 1,237	千株 1,195	千円 409,287
トラスコ中山	6.9	6.9	35,742	VTホールディングス	14.7	21.7	9,699	三井住友フィナンシャルG	422.8	461.2	1,585,144
オートバックスセブン	19.8	21.5	31,820	ユナイテッドアローズ	7.4	8.3	20,351	第四銀行	70	66	26,202
加藤産業	8.5	8.2	18,163	ハイデイト日高	4.9	5.6	12,829	北越銀行	68	64	14,272
イノテック	—	19.1	9,416	京都きもの友禅	8.1	8.5	7,539	西日本シティ銀行	194	178	36,668
イエローハット	5.9	5.8	11,663	コロナワイド	20	19.3	36,477	千葉銀行	216	218	128,402
日伝	2.6	2.9	8,244	香番屋	2.8	5.4	17,604	横浜銀行	375	—	—
因幡電機産業	8.3	6.8	23,698	スキホールディングス	9.9	10.2	54,264	常陽銀行	197	198	93,456
ミスミグループ本社	63.3	64	114,624	スクロール	—	19.8	7,385	群馬銀行	128	122	57,462
ゼンショー	25.3	25.8	83,592	ヨンドシーホールディングス	4.9	4.8	10,790	武蔵野銀行	9	8.9	24,172
ジェコ	4.9	4.9	4,125	ユニー・ファミリマートHD	18.5	25.6006	173,572	千葉興業銀行	13.9	19	7,543
小売業 (4.8%)				木曾路	6.9	7.9	17,925	筑波銀行	27.7	27.4	8,192
ローソン	20.7	22	172,260	サトレストラシステムズ	—	10.4	8,663	七十七銀行	92	87	36,279
サンエー	4.5	4	19,360	千趣会	12.9	14.2	9,443	青森銀行	50	43	13,330
カワチ薬品	5.3	4.9	11,686	ケーヨー	14.7	13.2	6,679	秋田銀行	43	40	12,280
エービーシー・マート	8	7.6	50,616	上新電機	13	15	12,735	山形銀行	35	34	14,484
ハードオフコーポレーション	—	6.9	7,721	日本瓦斯	9.3	9	28,080	岩手銀行	4	4.1	16,687
アスクル	5.9	7.2	26,640	ロイヤルホールディングス	10.4	10	17,180	東邦銀行	52	49	17,444
ゲオホールディングス	12	11.2	14,784	いなげや	6.9	7.6	10,396	東北銀行	—	89	12,994
アダストリア	5	10.9	24,252	島忠	14	14.6	35,127	みちのく銀行	32	30	6,090
くらこポレション	3.8	3.6	16,884	チヨダ	6.9	6.8	16,401	ひくおかフィナンシャルG	227	246	102,582
キャンドゥ	4.9	5.6	9,010	ライフコーポレーション	4	4.1	12,648	静岡銀行	164	165	136,455
バルグループHLDGS	3.7	3.7	8,558	リンガーハット	6.3	5.8	13,258	十六銀行	71	69	20,286
エディオン	27.6	24.8	21,377	AOKIホールディングス	13.6	13.4	15,356	スルガ銀行	57.7	56.6	139,405
あみやき亭	1.4	1.5	5,490	オークワ	10	10	9,370	八十二銀行	99	97	50,925
ひらまつ	11	12.6	7,320	コムリ	9.8	8.7	20,610	山梨中央銀行	37	34	14,280
ゲンキョー	0.9	1.7	6,196	青山商事	14.1	10.9	37,877	大垣共立銀行	72	75	26,175
ハニーズ	6	6.7	8,227	しまむら	6.4	6.7	79,194	福井銀行	51	51	13,209
アルペン	5.3	5.5	10,081	高島屋	82	84	68,796	北國銀行	60	59	18,408
Qオーレ	6.8	6.8	9,533	松屋	12	12.5	9,000	清水銀行	2.6	2.7	7,360
ジェイアイエヌ	4.1	4.1	18,163	エイチ・ツー・オーリテイリング	26.9	29.2	42,427	滋賀銀行	53	49	24,451
ビックカメラ	26.9	32.6	27,416	近鉄百貨店	21	27	9,126	南都銀行	49	52	19,084
DCMホールディングス	28.6	28	24,024	ニッセンHD	17.9	—	—	百五銀行	55	50	18,900
Monotaro	10.1	21	55,650	パルコ	8.2	6.6	6,408	京都銀行	105	107	80,143
アークランドサービスHD	6.6	2.6	7,904	丸井グループ	60	70.6	99,616	紀陽銀行	21.9	21.7	34,155
J. フロント リテイリング	71.2	72.4	92,382	アクシアル リテイリング	5	4.8	15,480	三重銀行	39	28	5,796
ドットコム・日レスHD	10.3	10.2	19,033	イオン	229.6	238.5	355,365	ほくほくフィナンシャルG	365	370	52,170
マツモトキヨシHLDGS	12.7	11.9	60,095	ユニーグループ・HD	57.8	—	—	広島銀行	160	165	68,970
プロンコピリー	1.6	3.3	9,810	イズミ	12.7	11.2	47,712	山陰合同銀行	35	34	23,800
スタートトゥデイ	17.7	18	89,550	東武ストア	18	1.7	4,722	中国銀行	37.4	37.8	46,645
トレジャー・ファクトリー	0.6	—	—	平和堂	12.1	11.7	24,078	鳥取銀行	—	34	5,712
物語コーポレーション	1.8	1.9	8,483	フジ	7	6.8	13,219	伊予銀行	58.3	55.8	35,265
ココカラファイン	6.2	6.1	23,088	ヤオコー	6.7	6.6	26,664	百十四銀行	62	60	18,480
三越伊勢丹HD	111.3	113.5	116,905	ゼビオホールディングス	7.9	8	12,488	四国銀行	50	46	10,028
ウエルシアHD	5.3	5.1	33,915	ケーズホールディングス	13	23.8	40,483	阿波銀行	43	44	28,116
クリエイトSDH	2.9	8.9	20,407	アインホールディングス	7.1	7.1	44,588	鹿児島銀行	38	—	—
チムニー	0.9	2	5,376	ヤマダ電機	217.2	170.9	86,817	大分銀行	36	33	11,715
ジョイフル本田	7.4	9.3	23,919	アークランドサカモト	4.6	10.7	11,994	宮崎銀行	42	39	10,530
すかいらーく	17.9	17.7	23,452	ニトリホールディングス	24	25.3	282,348	肥後銀行	47	—	—
ユナイテッド・スーパーマーケット	19.8	19.4	19,050	吉野家ホールディングス	15.5	21.2	30,485	佐賀銀行	44	38	9,310
あさひ	4.5	5.3	6,815	松屋フーズ	3.4	3.6	10,836	十八銀行	41	37	11,396
日本調剤	0.6	1.9	7,581	サガミチェーン	9	9.5	11,913	沖縄銀行	4.5	5.5	16,555
コスモス薬品	2.9	2.9	57,014	王将フードサービス	4	4.3	17,479	琉球銀行	12.7	12.5	14,937
セブン&アイ・HLDGS	233.9	241.4	1,097,404	プレナス	6.6	6.7	12,127	セブン銀行	187	208.7	71,166
薬王堂	0.3	—	—	ミニストップ	5.3	4.9	8,584	みずほフィナンシャルG	7,840.3	8,180.9	1,425,112
クリエイト・レストランツ・ホール	4.7	16.8	17,136	アークス	9.9	10.7	26,215	高知銀行	—	107	11,556
ツルハホールディングス	11.9	13.5	145,125	パローホールディングス	12.8	12.4	35,290	山口フィナンシャルG	54	51	54,468
サンマルクホールディングス	4.6	4.8	13,190	ベルク	3.2	3.1	11,470	長野銀行	—	33	6,468
トリドール	6.8	7.3	16,563	ファーストリテイリング	11.2	9.7	315,347	名古屋銀行	52	48	16,896
クスリのアオキ	4.8	5.5	21,450	サンドラッグ	11.8	12.4	98,580	北洋銀行	80.1	82.5	29,535
メディカルシステムネットワーク	2.9	14.9	7,017	ザックスパーホールディング	5.1	7	7,266	愛知銀行	2.4	2.1	10,731
総合メディカル	3.4	3.1	10,307	ベルーナ	17.1	15.9	9,762	第三銀行	45	39	6,825
カップ・クリエイト	9.9	9.4	11,703	銀行業 (7.7%)				中京銀行	—	27	6,453
ライオン	—	5.7	6,857	じもとホールディングス	47.1	51.6	7,224	東日本銀行	30	—	—
良品計画	6.9	6.7	128,908	足利ホールディングス	33.8	42.2	16,922	大光銀行	34	28	6,076
アルビス	—	2.3	4,797	東京TYフィナンシャルG	7.5	8.3	23,430	愛媛銀行	37	31	7,967
コナカ	9.1	11	5,423	九州フィナンシャルG	—	86	55,126	トマト銀行	46	85	13,005
コーナン商事	10.6	8.9	17,043	ゆうちょ銀行	—	150.5	184,362	みなと銀行	52	57	9,462
ワタミ	8.6	9	10,440	コンコディア・フィナンシャル	—	393.2	190,977	京業銀行	44	44	18,920
ドンキホーテホールディング	36	37.2	132,432	新生銀行	543	519	79,407	関西アーバン銀行	6	6.7	6,746
西松屋チェーン	12.3	12	17,616	あおぞら銀行	390	372	132,060	松屋銀行	32	33	13,827
ゼンショーホールディングス	28.5	29.4	52,243	三菱UFJフィナンシャルG	4,488.1	4,616.9	2,379,550	北日本銀行	2.5	2.8	7,767
幸楽苑ホールディングス	6.2	5.6	8,635	りそなホールディングス	655.7	673.8	292,429	東和銀行	87	91	8,008

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額	
福島銀行	千株	千株	千円				東京建物	千株	千株	千円				ユー・エス・エス	千株	千株	千円				
大東銀行	99	102	9,282				ダイビル	62.5	62.8	76,239				東京個別指導学院	70.8	73	123,881				
トモニホールディングス	55	61	10,492				京阪神ビルディング	16.3	15.7	13,784				サイバーエージェント	1.4	-	-				
フィデアホール	46.4	45.2	21,470				住友不動産	16.1	11.8	5,982				セントラルスポーツ	13.9	16.2	89,748				
池田泉州HD	40	55.5	8,769				テオーシー	133	138	359,559				リクルートホールディングス	275.5	310.8	412,742				
証券・商品先物取引業 (1.0%)	47.1	53	24,963				東京築天地	90	107	18,832				テクノ・ホールディング	4	3	7,230				
F P G	16	21.2	19,504				レオパレス21	20.9	23	17,733				ジャパンマテリアル	4.8	8	6,704				
S B I	67.9	68.8	81,321				スターツコーポレーション	16	19	9,120				ベクトル	7.7	10.3	35,586				
ジャフコ	8.1	10	29,000				フジ住宅	7.7	6.9	12,137				キャリアリンク	1.9	3.2	11,056				
大和証券G本社	519	527	302,656				空浩施設	13	12.2	8,308				N・フィールド	-	8.4	7,551				
野村ホールディングス	1,139.2	1,092.9	504,045				住友不動産販売	10.9	12.1	6,050				リクルートホールディングス	88.9	124.1	475,923				
岡三証券グループ	49	42	21,504				ゴールドクレスト	4.1	4.6	9,181				日本郵政	-	180.8	241,910				
丸三証券	19.8	19.2	16,185				タカラレーベン	5.6	4.9	7,928				リョクグループ	2.2	2.4	37,032				
東洋証券	31	35	6,335				サンヨーハウジ 名古屋	27.8	27.1	17,723				東祥	0.7	2.2	9,878				
東海東京HD	65.6	64.7	32,285				イオンモール	5.9	5.9	5,186				エイチ・アイ・エス	10	10	26,040				
光世証券	-	68	7,820				トーセイ	36	36	52,848				共立メンテナンス	3.8	4.7	30,315				
水戸証券	24.8	27.5	6,765				エヌ・ティ・ティ都市開発	10.5	11.1	8,003				イチメンホールディングス	10.2	11.7	10,834				
いちよし証券	13.8	16.2	13,332				サンフロンティア不動産	36.4	34.4	32,748				建設技術研究所	10.2	5.7	5,130				
松井証券	29.4	23.5	21,502				エフ・ジェー・ネクスト	7.1	8.5	8,321				東京テアトル	47	98	11,662				
マネックスG	70.1	74.4	17,930				日本空港ビルデング	-	14.9	7,673				よみうりランド	17	18	8,442				
カブドットコム証券	54.2	55.8	18,525				サービス業 (3.8%)	19.4	18.2	72,572				東京都競馬	47	45	8,955				
極東証券	9.4	9.9	13,295				日本工営	25	23	9,821				常磐興産	44	79	12,245				
岩井コスモホールディング	7.2	7.8	7,176				ネクスト	16.2	18.6	13,968				カナモト	8.7	8.6	20,700				
監理證券	5	14.1	7,966				日本M&Aセンター	9.7	9.7	58,200				東京ドーム	48	26	25,480				
マネースクウェアHD	1.4	7.8	9,703				アコーディア・ゴルフ	24.2	16.7	17,785				西尾レントオール	5.2	5.1	13,856				
保険業 (2.4%)	-	24.4	55,510				タケエィ	8.1	9.3	7,412				トランス・コスモス	8.4	7.6	19,760				
かんぽ生命保険	-	24.4	55,510				パソナグループ	3.5	7.4	5,705				乃村工務社	13	13.9	19,293				
損保ジャパン興亜HD	124.2	126.9	401,004				G C A	6	8.6	6,389				藤田観光	27	25	8,975				
アニコムホールディングス	2.5	5.2	12,594				エス・エム・エス	7.5	8.6	20,347				KNT-CTホールディングス	33	37	4,329				
MS & AD	178.3	170.3	495,487				テナホールディングス	12.1	43.6	70,457				日本財財	4	6.2	9,399				
SONY FH	54	56.5	83,789				クックパッド	12.6	14.5	14,007				トーカイ	3.3	3.1	10,168				
第一生命	358.2	365.3	525,484				エスクリ	0.9	-	-			セコム	57.3	63.4	481,586					
東京海上HD	226.7	231.8	903,324				学情	1.4	-	-			丹青社	12.6	13.6	9,846					
T & Dホールディングス	203.9	207.8	253,931				スタジオリス	3.8	3.6	7,725				メイテック	8.5	7.8	27,378				
その他金融業 (1.3%)	-	15.2	61,332				ジミックホールディングス	3.6	4.2	6,039				アサツキ ディ・ケイ	11.5	10.7	27,338				
全国保証	15.1	15.2	61,332				総合警備保障	19.9	20.7	104,949				応用地質	7.4	7.4	7,666				
クレディセゾン	45.9	43.5	75,255				カカコム	40.1	44.5	78,275				船井総研ホールディン	8.7	9.9	14,384				
アクリーティブ	1.9	-	-				アイロムグループ	0.8	-	-				ベネッセホールディングス	20.9	20	52,600				
芙蓉総合リース	6.2	6.7	32,897				ディップ	7.5	7.6	22,625				イオンディライト	6.2	6.2	18,438				
興銀リース	11.2	11.1	22,344				新日本科学	7.1	-	-				ナック	5.7	-	-				
東京センチュリーリース	13.3	13.4	48,843				ツクイ	9.1	17	12,138				ニチイ学館	13.6	12	9,300				
日本証券金融	26.4	24.1	10,700				エムスリー	51.8	54.1	165,275				ダイセキ	10.6	12.1	22,288				
アイフル	93.3	98.2	30,834				ツカガ・グローバル	6.6	6.8	4,583				合計	株数・金額	95,120.9	96,137.1006	113,492.368			
ポケットカード	-	9.4	4,794				アウトソーシング	2.3	3.3	11,946				銘柄数<比率>	1,395銘柄	1,397銘柄	<99.7%>				
リコーリース	5.3	4.9	12,960				ウェルネット	1.5	6.3	8,328				(注1)							
イオンフィナンシャルサービス	37.1	37.4	66,833				ディー・エヌ・エー	29.8	28.1	107,342				(注2)							
アコム	113.3	122.6	59,951				博報堂DYHLDGS	81.4	83.4	95,826				(注3)							
ジャックス	33	33	13,068				ぐるなび	7.5	7.5	19,747											
オリコ	131.8	248.4	49,431				エスアールジータカミヤ	3.3	-	-											
日立キャピタル	11.4	13.9	31,024				一体	5.5	-	-											
アプラスフィナンシャル	21	-	-				ファンコミュニケーションズ	12.6	15.9	11,829											
オリックス	394.5	408.8	601,140				インフォマート	-	13	13,286											
三菱UFJリース	138.1	141.1	65,047				J Pホールディングス	21.1	22.2	6,060											
日本取引所グループ	81.6	166.7	269,053				E P Sホールディングス	7.1	7.7	10,387											
イー・ギャラリー	1.2	3.1	8,063				プレステージ・インター	6.8	6.7	10,452											
NECキャピタルリソリューション	3.6	3.4	5,589				アミューズ	2.4	4.2	7,543											
不動産業 (2.5%)	-	60.9	26,004				ドリームインキュベータ	1.4	3.6	7,254											
いちじ	-	60.9	26,004				クイック	1.6	-	-											
日本駐車場開発	73.7	78.1	10,855				ケネディクス	83.5	82.3	37,858											
ヒューリック	115	120	118,440				電通	65.9	68.1	361,611											
野村不動産HL DGS	33.8	37	62,900				イオンファンタジー	-	3	7,851											
三重交通グループHD	-	14.7	5,615				ネクシースグループ	-	1.5	-											
日本商業開発	1	-	-				みらかホールディングス	15.2	15.3	77,418											
アプラスコーポレーション	2.5	2.3	9,729				アルプス技研	1.7	3.8	8,029											
ユニバーホールディングス	2.6	4.1	11,496				オリエンタルランド	63.7	66.3	408,474											
日本管理センター	2.8	5.5	6,710				ダスキン	16.9	17.3	31,849											
オープンハウス	8	8.9	20,203				ファルコホールディングス	8.3	8.9	8,588											
東急不動産HD	150	139.3	75,500				ラウンドダウン	19.1	20.8	14,851											
飯田GHD	35.7	52.6	101,518				リゾートトラスト	22.9	25.2	51,332											
パーク24	28.8	29	89,465				ピー・エム・エル	4.1	8	20,728											
三井不動産	29.6	305	633,332				りらいあコミュニケーション	12.5	11	10,120											
三菱地所	415	431	807,263																		
平和不動産	13.4	12.2	16,616																		

■投資信託財産の構成

2016年9月20日現在

項目	当期		比率
	評価額	千円	
株式	113,492,368		96.0%
コール・ローン等、その他	4,748,839		4.0%
投資信託財産総額	118,241,208		100.0%

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年9月20日現在

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

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

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、適格機関投資家専用投信1号1,611,697,194円、トピックス・インデックスファンド5,870,349,708円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A 14,459,562,673円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2 123,973,859円、ダイワ国内重視バランスファンド3 0 V A (一般投資家私募) 155,132,020円、ダイワ国内重視バランスファンド5 0 V A (一般投資家私募) 2,622,187,560円、ダイワ国際分散バランスファンド3 0 V A (一般投資家私募) 118,142,999円、ダイワ国際分散バランスファンド5 0 V A (一般投資家私募) 3,671,223,973円、D-I's T O P I Xインデックス33,397,291円、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド24,801,250円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 593,766円、i F r e e T O P I Xインデックス14,707,636円、i F r e e 8資産バランス9,416,329円、D Cダイワ日本株式インデックス64,175,618,880円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 2,466,829,698円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 2,424,386,068円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 2,171,081,155円、年金ダイワ日本株式インデックス3,783,254,324円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 26,357,149円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 62,358,348円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 12,485,710円、ダイワ世界分散/バランスファンド1 5 V A 448,097円、ダイワ世界分散/バランスファンド2 0 V A 440,730円、ダイワ世界分散/バランスファンド2 0 V A (国内株式型) 941,908円、ダイワ世界分散/バランスファンド2 5 V A 65,202,419円、ダイワ世界分散/バランスファンド3 0 V A 369,460,228円、ダイワ世界分散/バランスファンド3 0 V A (国内株式型) 200,755,185円、ダイワ世界/バランスファンド4 0 V A 1,628,116,331円、ダイワ世界/バランスファンド6 0 V A 256,425,062円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 15,311,443,452円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 432,461,659円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 742,797,027円、ダイワ・バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家専用) 1,317,289,178円、ダイワ国内/バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家専用) 203,482,755円、ダイワ国内/バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家専用) 327,434,084円、ダイワ・ノーロード T O P I Xファンド26,401,434円、ダイワ・インデックスセレクト T O P I X 967,581,041円、ダイワライフスタイル2 5 225,777,125円、ダイワライフスタイル5 0 688,315,084円、ダイワライフスタイル7 5 518,580,161円、D C・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド) 16,119,720,217円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は7,944円です。

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

■損益の状況

当期 自2015年9月25日 至2016年9月20日

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

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

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

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

運用報告書 第12期（決算日 2016年11月30日）

（計算期間 2015年12月1日～2016年11月30日）

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の第12期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をNOMURA-BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。）
運用方法	①主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（NOMURA-BPI総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。 ②運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
株式組入制限	純資産総額の10%以下

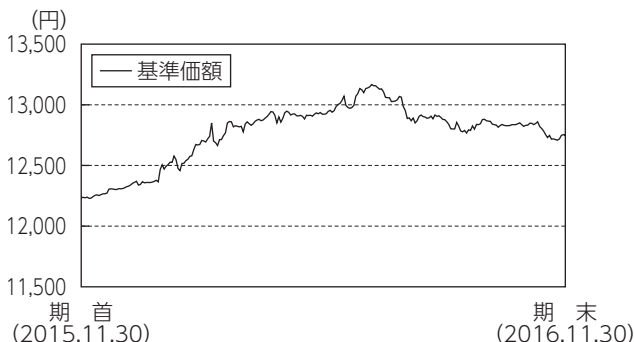
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



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

(注1) 騰落率は期首比。

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

(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。

(注4) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：12,236円 期末：12,749円 騰落率：4.2%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内債券市況

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

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆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》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	－円
有価証券取引税	－
その他費用	－
合計	－

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

■ 売買および取引の状況
公 社 債

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	3,805,658	2,726,492 (－)
	地方債証券	100,333	620,871 (－)
内	特殊債券	103,989	558,994 (－)
	社債券	401,942	606,719 (－)

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

■ 主要な売買銘柄
公 社 債

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

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

■ 組入資産明細表

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

区 分	当 期			末			
	額面金額	評 価 額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	10,012,000	11,327,843	76.2	－	56.6	15.9	3.7
地方債証券	1,200,000	1,237,940	8.3	－	2.8	2.8	2.7
特殊債券 (除く金融債券)	900,000	926,951	6.2	－	1.4	2.1	2.7
普通社債券	900,000	917,180	6.2	－	－	5.5	0.7
合 計	13,012,000	14,409,916	97.0	－	60.8	26.3	9.9

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

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

区 分	当 期			末	
	銘 柄	年利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	362 2年国債	0.1000	124,000	124,502	2018/03/15
	364 2年国債	0.1000	20,000	20,087	2018/05/15
	365 2年国債	0.1000	53,000	53,232	2018/06/15
	366 2年国債	0.1000	80,000	80,362	2018/07/15
	368 2年国債	0.1000	120,000	120,601	2018/09/15
	114 5年国債	0.3000	62,000	62,548	2018/09/20
	296 10年国債	1.5000	35,000	36,061	2018/09/20
	40 20年国債	2.3000	51,000	53,288	2018/09/20
	116 5年国債	0.2000	133,000	134,025	2018/12/20
	297 10年国債	1.4000	20,000	20,645	2018/12/20
	298 10年国債	1.3000	61,000	62,844	2018/12/20
	300 10年国債	1.5000	8,000	8,306	2019/03/20
	41 20年国債	1.5000	40,000	41,539	2019/03/20
	42 20年国債	2.6000	22,000	23,404	2019/03/20
	119 5年国債	0.1000	21,000	21,142	2019/06/20
	301 10年国債	1.5000	35,000	36,486	2019/06/20
	302 10年国債	1.4000	54,000	56,155	2019/06/20
	120 5年国債	0.2000	10,000	10,099	2019/09/20
	121 5年国債	0.1000	25,000	25,179	2019/09/20
	43 20年国債	2.9000	14,000	15,202	2019/09/20
	122 5年国債	0.1000	15,000	15,112	2019/12/20
	305 10年国債	1.3000	100,000	104,409	2019/12/20
	123 5年国債	0.1000	80,000	80,621	2020/03/20
	306 10年国債	1.4000	10,000	10,508	2020/03/20
	44 20年国債	2.5000	32,000	34,785	2020/03/20
	45 20年国債	2.4000	20,000	21,674	2020/03/20
	124 5年国債	0.1000	110,000	110,881	2020/06/20
308 10年国債	1.3000	100,000	105,078	2020/06/20	
309 10年国債	1.1000	103,000	107,495	2020/06/20	
46 20年国債	2.2000	19,000	20,573	2020/06/22	
125 5年国債	0.1000	138,000	139,157	2020/09/20	
310 10年国債	1.0000	30,000	31,276	2020/09/20	
311 10年国債	0.8000	42,000	43,466	2020/09/20	
47 20年国債	2.2000	23,000	25,033	2020/09/21	

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

区 分	当 期	年 率	末		
			額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
銘 柄		%	千 円	千 円	
126	5年国債	0.1000	124,000	125,083	2020/12/20
312	10年国債	1.2000	94,000	99,008	2020/12/20
48	20年国債	2.5000	9,000	9,956	2020/12/21
127	5年国債	0.1000	159,000	160,440	2021/03/20
313	10年国債	1.3000	75,000	79,563	2021/03/20
314	10年国債	1.1000	77,000	81,020	2021/03/20
49	20年国債	2.1000	4,000	4,381	2021/03/22
50	20年国債	1.9000	30,000	32,598	2021/03/22
128	5年国債	0.1000	147,000	148,375	2021/06/20
315	10年国債	1.2000	90,000	95,345	2021/06/20
316	10年国債	1.1000	56,000	59,069	2021/06/20
51	20年国債	2.0000	25,000	27,387	2021/06/21
129	5年国債	0.1000	35,000	35,345	2021/09/20
317	10年国債	1.1000	40,000	42,304	2021/09/20
318	10年国債	1.0000	33,000	34,742	2021/09/20
52	20年国債	2.1000	19,000	21,012	2021/09/21
319	10年国債	1.1000	129,000	136,821	2021/12/20
320	10年国債	1.0000	35,000	36,944	2021/12/20
53	20年国債	2.1000	13,000	14,451	2021/12/20
54	20年国債	2.2000	14,000	15,634	2021/12/20
321	10年国債	1.0000	65,000	68,770	2022/03/20
322	10年国債	0.9000	73,000	76,845	2022/03/20
55	20年国債	2.0000	41,000	45,549	2022/03/21
323	10年国債	0.9000	60,000	63,294	2022/06/20
324	10年国債	0.8000	88,000	92,341	2022/06/20
56	20年国債	2.0000	12,000	13,398	2022/06/20
57	20年国債	1.9000	24,000	26,655	2022/06/20
325	10年国債	0.8000	127,000	133,550	2022/09/20
58	20年国債	1.9000	35,000	39,060	2022/09/20
59	20年国債	1.7000	3,000	3,326	2022/12/20
328	10年国債	0.6000	30,000	31,290	2023/03/20
61	20年国債	1.0000	40,000	42,760	2023/03/20
329	10年国債	0.8000	45,000	47,590	2023/06/20
62	20年国債	0.8000	16,000	16,921	2023/06/20
63	20年国債	1.8000	30,000	33,690	2023/06/20
330	10年国債	0.8000	81,000	85,814	2023/09/20
331	10年国債	0.6000	63,000	65,883	2023/09/20
64	20年国債	1.9000	35,000	39,697	2023/09/20
332	10年国債	0.6000	118,000	123,512	2023/12/20
65	20年国債	1.9000	42,000	47,827	2023/12/20
66	20年国債	1.8000	30,000	33,950	2023/12/20
333	10年国債	0.6000	153,000	160,281	2024/03/20
67	20年国債	1.9000	19,000	21,705	2024/03/20
68	20年国債	2.2000	25,000	29,108	2024/03/20
69	20年国債	2.1000	12,000	13,884	2024/03/20
334	10年国債	0.6000	156,000	163,558	2024/06/20
70	20年国債	2.4000	18,000	21,324	2024/06/20
71	20年国債	2.2000	17,000	19,882	2024/06/20
335	10年国債	0.5000	22,000	22,920	2024/09/20
72	20年国債	2.1000	53,000	61,849	2024/09/20
336	10年国債	0.5000	48,000	50,052	2024/12/20
337	10年国債	0.3000	65,000	66,730	2024/12/20
73	20年国債	2.0000	30,000	34,913	2024/12/20

区 分	当 期	年 率	末		
			額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
銘 柄		%	千 円	千 円	
74	20年国債	2.1000	22,000	25,780	2024/12/20
338	10年国債	0.4000	145,000	150,122	2025/03/20
75	20年国債	2.1000	14,000	16,466	2025/03/20
76	20年国債	1.9000	25,000	28,988	2025/03/20
339	10年国債	0.4000	137,000	141,864	2025/06/20
78	20年国債	1.9000	17,000	19,794	2025/06/20
79	20年国債	2.0000	14,000	16,421	2025/06/20
80	20年国債	2.1000	20,000	23,630	2025/06/20
340	10年国債	0.4000	135,000	139,874	2025/09/20
81	20年国債	2.0000	39,000	45,924	2025/09/20
82	20年国債	2.1000	28,000	33,218	2025/09/20
341	10年国債	0.3000	136,000	139,754	2025/12/20
83	20年国債	2.1000	25,000	29,777	2025/12/20
84	20年国債	2.0000	27,000	31,915	2025/12/20
342	10年国債	0.1000	40,000	40,371	2026/03/20
85	20年国債	2.1000	31,000	37,068	2026/03/20
86	20年国債	2.3000	6,000	7,286	2026/03/20
87	20年国債	2.2000	20,000	24,101	2026/03/20
343	10年国債	0.1000	152,000	153,377	2026/06/20
88	20年国債	2.3000	33,000	40,227	2026/06/20
89	20年国債	2.2000	15,000	18,142	2026/06/20
344	10年国債	0.1000	90,000	90,747	2026/09/20
90	20年国債	2.2000	37,000	44,910	2026/09/20
91	20年国債	2.3000	12,000	14,683	2026/09/20
92	20年国債	2.1000	45,000	54,360	2026/12/20
93	20年国債	2.0000	18,000	21,639	2027/03/20
94	20年国債	2.1000	29,000	35,161	2027/03/20
95	20年国債	2.3000	30,000	37,121	2027/06/20
96	20年国債	2.1000	23,000	27,976	2027/06/20
97	20年国債	2.2000	25,000	30,790	2027/09/20
98	20年国債	2.1000	29,000	35,404	2027/09/20
99	20年国債	2.1000	43,000	52,657	2027/12/20
100	20年国債	2.2000	35,000	43,403	2028/03/20
101	20年国債	2.4000	18,000	22,725	2028/03/20
102	20年国債	2.4000	10,000	12,669	2028/06/20
103	20年国債	2.3000	21,000	26,364	2028/06/20
104	20年国債	2.1000	24,000	29,580	2028/06/20
105	20年国債	2.1000	38,000	47,000	2028/09/20
106	20年国債	2.2000	16,000	19,976	2028/09/20
107	20年国債	2.1000	43,000	53,366	2028/12/20
108	20年国債	1.9000	43,000	52,339	2028/12/20
109	20年国債	1.9000	35,000	42,703	2029/03/20
110	20年国債	2.1000	16,000	19,911	2029/03/20
111	20年国債	2.2000	35,000	44,135	2029/06/20
112	20年国債	2.1000	29,000	36,209	2029/06/20
113	20年国債	2.1000	66,000	82,630	2029/09/20
114	20年国債	2.1000	45,000	56,483	2029/12/20
115	20年国債	2.2000	22,000	27,897	2029/12/20
2	30年国債	2.4000	9,000	11,670	2030/02/20
116	20年国債	2.2000	27,000	34,326	2030/03/20
117	20年国債	2.1000	37,000	46,557	2030/03/20
3	30年国債	2.3000	4,000	5,151	2030/05/20
118	20年国債	2.0000	13,000	16,225	2030/06/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

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

区 分	当 期	年 率	期 末			償還年月日
			額 面 金 額	評 価 額	評 価 額	
銘 柄		%	千円	千円	千円	
21	30年国債	2.3000	16,000	21,533	2035/12/20	
155	20年国債	1.0000	63,000	69,814	2035/12/20	
22	30年国債	2.5000	17,000	23,542	2036/03/20	
156	20年国債	0.4000	63,000	62,719	2036/03/20	
23	30年国債	2.5000	16,000	22,172	2036/06/20	
157	20年国債	0.2000	77,000	73,607	2036/06/20	
24	30年国債	2.5000	15,000	20,836	2036/09/20	
158	20年国債	0.5000	38,000	38,380	2036/09/20	
25	30年国債	2.3000	17,000	22,995	2036/12/20	
26	30年国債	2.4000	32,000	43,972	2037/03/20	
27	30年国債	2.5000	26,000	36,414	2037/09/20	
28	30年国債	2.5000	34,000	47,823	2038/03/20	
29	30年国債	2.4000	38,000	52,920	2038/09/20	
30	30年国債	2.3000	40,000	55,162	2039/03/20	
31	30年国債	2.2000	38,000	51,858	2039/09/20	
32	30年国債	2.3000	42,000	58,506	2040/03/20	
33	30年国債	2.0000	55,000	73,247	2040/09/20	
34	30年国債	2.2000	45,000	62,247	2041/03/20	
35	30年国債	2.0000	53,000	71,168	2041/09/20	
36	30年国債	2.0000	59,000	79,588	2042/03/20	
37	30年国債	1.9000	57,000	75,755	2042/09/20	
38	30年国債	1.8000	35,000	45,840	2043/03/20	
39	30年国債	1.9000	37,000	49,429	2043/06/20	
40	30年国債	1.8000	29,000	38,089	2043/09/20	
41	30年国債	1.7000	29,000	37,425	2043/12/20	
42	30年国債	1.7000	33,000	42,664	2044/03/20	
43	30年国債	1.7000	37,000	47,924	2044/06/20	
44	30年国債	1.7000	32,000	41,524	2044/09/20	
45	30年国債	1.5000	33,000	41,168	2044/12/20	
46	30年国債	1.5000	43,000	53,658	2045/03/20	
47	30年国債	1.6000	40,000	51,055	2045/06/20	
48	30年国債	1.4000	45,000	55,126	2045/09/20	
49	30年国債	1.4000	39,000	47,842	2045/12/20	
50	30年国債	0.8000	44,000	46,893	2046/03/20	
51	30年国債	0.3000	40,000	37,174	2046/06/20	
52	30年国債	0.5000	28,000	27,500	2046/09/20	
1	40年国債	2.4000	24,000	36,487	2048/03/20	
2	40年国債	2.2000	23,000	33,919	2049/03/20	
3	40年国債	2.2000	19,000	28,259	2050/03/20	
4	40年国債	2.2000	30,000	44,930	2051/03/20	
5	40年国債	2.0000	35,000	50,523	2052/03/20	
6	40年国債	1.9000	28,000	39,737	2053/03/20	
7	40年国債	1.7000	31,000	42,097	2054/03/20	
8	40年国債	1.4000	23,000	29,000	2055/03/20	
9	40年国債	0.4000	22,000	20,183	2056/03/20	
種別	銘柄数		238銘柄			
小計	金額		10,012,000	11,327,843		
地方債証券	24-6 京都市5年	0.1370	100,000	100,218	2018/03/28	
	20-1 千葉市公債	1.5500	100,000	102,206	2018/04/25	
	660 東京都公債	1.5800	100,000	102,499	2018/06/20	
	20-6 北海道公債	1.7200	100,000	103,053	2018/08/29	
	21-2 埼玉県公債	1.5700	100,000	104,004	2019/05/27	
	76 共同発行地方	1.4000	100,000	103,808	2019/07/25	

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年11月30日現在

当		期		末													
区	分	銘	柄	年	利率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日
					%			千円			千円						
		21-6	大阪市公債	1.5700		100,000				104,769				2019/11/25			
		21-35	兵庫県公債	1.4600		100,000				104,644				2020/01/22			
		116	共同発行地方	0.8000		100,000				104,582				2022/11/25			
		117	共同発行地方	0.7200		100,000				104,149				2022/12/22			
		24-16	愛知県公債	0.7570		100,000				104,453				2023/01/31			
		28-1	静岡県公債	0.0800		100,000				99,550				2026/03/19			
種別小計	銘柄数	12銘柄						1,200,000		1,237,940							
種別小計	金額																
特殊債券 (除く金融債)		3	政保地方公共6年	0.4000		100,000				100,491				2018/01/30			
		30	国際協力銀行	1.8700		100,000				102,396				2018/03/20			
		56	政保道路機構	1.4000		100,000				101,956				2018/04/20			
		2	政保地方公営機	1.6000		100,000				103,195				2018/11/16			
		5	日本政策投資CO	1.7450		100,000				103,933				2019/03/20			
		98	政保道路機構	1.3000		100,000				104,211				2020/01/31			
		122	政保道路機構	0.9000		100,000				103,649				2020/11/30			
		190	政保道路機構	0.6050		100,000				103,857				2023/05/31			
		65	地方公共団体	0.5350		100,000				103,259				2024/10/28			
種別小計	銘柄数	9銘柄						900,000		926,951							
種別小計	金額																
普通社債券		15	NTTドコモ	1.9600		100,000				102,920				2018/06/20			
		35	みずほBK	0.2850		100,000				100,540				2019/01/25			
		25	東日本高速道	0.2990		100,000				100,567				2019/03/20			
		27	東日本高速道	0.2480		100,000				100,533				2019/06/20			
		1	明治安田2014基	0.5100		100,000				100,653				2019/08/07			
		164	オリックス	1.1460		100,000				102,682				2019/08/07			
		62	トヨタファイナンス	0.2030		100,000				100,316				2019/12/20			
		70	東日本旅客鉄道	1.1930		100,000				104,025				2020/09/29			
		33	中日本高速道	1.0840		100,000				104,942				2021/09/17			
種別小計	銘柄数	9銘柄						900,000		917,180							
種別小計	金額																
合計	銘柄数	268銘柄						13,012,000		14,409,916							
合計	金額																

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

項	目	当		期		末
		評	価	額	比	
				千円		%
公社債				14,409,916		96.5
コール・ローン等、その他				525,756		3.5
投資信託財産総額				14,935,672		100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

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

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

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 34,845円、iFree 日本債券インデックス38,680,905円、iFree 8資産バランス48,315,209円、ダイワ・ライフ・バランス30 4,301,131,882円、ダイワ・ライフ・バランス50 2,079,325,322円、ダイワ・ライフ・バランス70 645,819,420円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)503,783,917円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)410,849,190円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)119,616,392円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 59,505,016円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 37,620,868円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 2,109,162円、ダイワ世界バランスファンド40VA24,457,090,076円、ダイワ世界バランスファンド60VA234,409,930円、ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA266,358,395円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA453,309,283円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,749円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月1日 至2016年11月30日

項	目	当	期
(A) 配当等収益			161,784,953円
	受取利息		161,811,719
	支払利息	△	26,766
(B) 有価証券売買損益			428,834,950
	売買益		500,992,880
	売買損	△	72,157,930
(C) その他費用		△	237
(D) 当期損益金(A+B+C)			590,619,666
(E) 前期繰越損益金			2,655,621,973
(F) 解約差損益金		△	576,583,438
(G) 追加信託差損益金			535,342,136
(H) 合計(D+E+F+G)			3,205,000,337
	次期繰越損益金(H)		3,205,000,337

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第17期（決算日 2016年11月30日）

（計算期間 2015年12月1日～2016年11月30日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

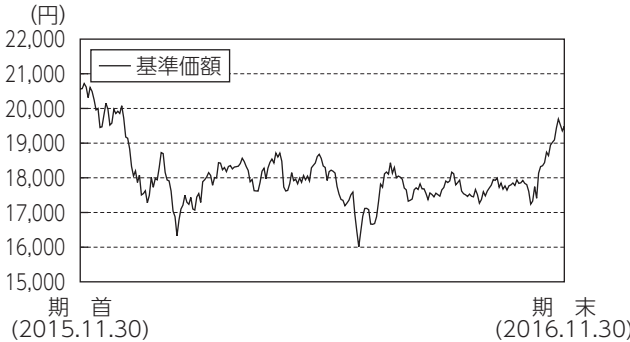
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：20,561円 期末：19,489円 騰落率：△5.2%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は、2016年1月に中国株式市場におけるサーキットブレーカー制度（現物株の取引を一時停止する制度）の発動による混乱、サウジアラビアとイランの国交断絶などによる地政学リスクの高まりなどを背景に大幅に下落しましたが、2月中旬以降は、産油国の生産量維持に関する合意による原油価格の反発や、米国経済指標の改善などを受けて反発しました。

3月以降は、ECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和の発表やFOMC（米国連邦公開市場委員会）での利上げ見送りなどが好感され堅調に推移しましたが、6月下旬の英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が多数となると欧州情勢への懸念が高まり、世界的なリスク回避の動きの中で一時急落しました。その後は、英国および各国の中央銀行が政策協調を表明したことが好感されて反発し、米国企業の良好な決算内容などを受けて上昇基調となりましたが、米国の利上げ観測に影響されて一進一退の展開が続き、期を通じてはやや上昇して期末を迎えました。

○為替相場

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

外国株式を中心に、S & 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

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

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

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

《今後の運用方針》

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

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

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIコクサイ指数（円ベース）は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数（米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数（米ドルベース）は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的財産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。

外国株式インデックスマザーファンド

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	1円
(株式)	(1)
(先物)	(0)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	1
(株式)	(1)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	11
(保管費用)	(11)
(その他)	(0)
合計	13

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

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

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

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

■主要な売買銘柄
株 式

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	期首		当 期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROADBRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	—	27	180	20,303	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	15	21	280	31,535	情報技術
JARDEN CORP	40	—	—	—	その他
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	13	14.5	153	17,252	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	38	196	662	74,476	金融
ABBOTT LABORATORIES	317	341	1,320	148,472	ヘルスケア
ARCONIC INC	273	103.33	203	22,849	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	33	37.5	314	35,361	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	87	101	627	70,567	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	66	72	492	55,388	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	60.29	71.79	566	63,677	情報技術
QORVO INC	32	32	173	19,526	情報技術
AFLAC INC	91	97	691	77,728	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	29	27.5	200	22,531	一般消費財・サービス
ADOBE SYSTEMS INC	107	114.5	1,201	135,092	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	50	50	137	15,418	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	25	25	145	16,390	一般消費財・サービス
PEOPLES UNITED FINANCIAL	68	68	125	14,134	金融
GARMIN LTD	26	26	135	15,196	一般消費財・サービス
AETNA INC	74.79	80.79	1,066	119,915	ヘルスケア
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	43	47.5	681	76,612	素材
ALTERA CORP	65	—	—	—	その他
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	158	166	1,881	211,511	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	37.51	37.51	189	21,337	情報技術
WR BERKLEY CORP	21	21	130	14,684	金融
AUTOZONE INC	6.7	6.7	529	59,521	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	47.21	55.71	499	56,159	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	—	209	791	88,955	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	24	26.5	203	22,843	公益事業
CELANESE CORP-SERIES A	33	33	254	28,625	素材
DR HORTON INC	71.66	79.66	229	25,827	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	21	21	99	11,145	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	30	55	332	37,389	ヘルスケア
AUTODESK INC	48	45.5	342	38,496	情報技術
MOODY'S CORP	39	40.5	409	46,026	金融
DEVON ENERGY CORP	82	109	459	51,661	エネルギー
ALBEMARLE CORP	24	26	223	25,122	素材
ATMOS ENERGY CORP	—	23	170	19,172	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	25	50	186	20,938	公益事業
CITIGROUP INC	643.23	661.23	3,671	412,710	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	101	106	1,028	115,637	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	105	115	704	79,211	公益事業
NETSUITE INC	8	—	—	—	その他
ALLEGHANY CORP	3.5	3.5	199	22,384	金融
DUN & BRADSTREET CORP	7.5	9	110	12,455	資本財・サービス
DOMINO'S PIZZA INC	—	11	187	21,130	一般消費財・サービス
HESS CORP	57	65	318	35,842	エネルギー
DAVITA INC	36	38	241	27,195	ヘルスケア
DANAHER CORP	131	142.5	1,127	126,765	ヘルスケア
FORTIVE CORP	—	72	398	44,744	資本財・サービス
AVNET INC	28	28	129	14,508	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	23.7	135	740	83,229	金融

銘柄	期首		当 期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	38	40	123	13,895	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	—	40.28	104	11,710	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	134	134	573	64,429	生活必需品
BUNGE LTD	31	31	208	23,387	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	88.25	82.25	552	62,155	情報技術
APPLE INC	1,211	1,239	13,809	1,552,508	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	94	94	635	71,457	金融
BOEING CO/THE	139	135	2,047	230,139	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	32.15	34.65	267	30,037	金融
SPECTRA ENERGY CORP	140.96	159.96	657	73,944	エネルギー
BENTON DICKINSON AND CO	44.37	48.87	844	94,897	ヘルスケア
CDK GLOBAL INC	29	29	170	19,120	情報技術
NISOURCE INC	—	73	163	18,358	公益事業
COLUMBIA PIPELINE GROUP	67	—	—	—	その他
CH. ROBINSON WORLDWIDE INC	31	33.5	251	28,237	資本財・サービス
CR BARD INC	16	16.8	362	40,772	ヘルスケア
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	240.71	250.71	1,179	132,609	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	871.54	936.04	4,770	536,250	電気通信サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	248	275.5	4,344	488,361	金融
ANSYS INC	19	21	198	22,316	情報技術
H&R BLOCK INC	51	51	114	12,831	一般消費財・サービス
BB&T CORP	168	190	838	94,303	金融
BROADCOM CORP-CL A	116.5	—	—	—	その他
BAKER HUGHES INC	92.23	95.73	578	65,088	エネルギー
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	356	387	2,181	245,202	ヘルスケア
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	13	13	104	11,734	生活必需品
JPMORGAN CHASE & CO	781.2	826.7	6,524	733,463	金融
LEGG MASON INC	21.5	—	—	—	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	56	56	410	46,196	金融
CIGNA CORP	55.5	59	815	91,731	ヘルスケア
LKQ CORP	68	68	224	25,234	一般消費財・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	10	10	131	14,729	金融
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	221.42	258.42	94	10,661	電気通信サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	25	50	234	26,379	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	—	69	183	20,625	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	39.6	39.6	443	49,887	金融
DOLLAR GENERAL CORP	65	65	509	57,223	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	30	38	316	35,626	情報技術
CATERPILLAR INC	121	134	1,260	141,664	資本財・サービス
CMS ENERGY CORP	60	64	267	30,103	公益事業
MOSAIC CO/THE	68	75.5	204	22,967	素材
DELTA AIR LINES INC	44	44	213	24,034	資本財・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	44	43.5	315	35,459	生活必需品
CORNING INC	266	247	596	67,114	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,083	1,159	3,457	388,669	情報技術
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	192	200	1,424	160,086	素材
IONIS PHARMACEUTICALS INC	26	—	—	—	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	317	333	1,351	151,989	金融
WABCO HOLDINGS INC	11	12.5	123	13,829	資本財・サービス
DOW CHEMICAL CO/THE	239	258	1,392	156,594	素材
MSCI INC	—	22	177	19,941	金融
COTY INC-CL A	—	111.39	217	24,481	生活必需品

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	56	61.5	191	21,529	一般消費財・サービス		
GENERAL MOTORS CO	308	319	1,102	123,974	一般消費財・サービス		
TRIPADVISOR INC	25	27.5	135	15,241	一般消費財・サービス		
LINKEDIN CORP - A	23	26	507	57,005	情報技術		
GENERAL DYNAMICS CORP	60	60.5	1,059	119,113	資本財・サービス		
GOLDMAN SACHS GROUP INC	83	83	1,757	197,580	金融		
GAMESTOP CORP-CLASS A	23	-	-	-	一般消費財・サービス		
ALPHABET INC-CL A	61.5	67.6	5,336	599,942	情報技術		
ALPHABET INC-CL C	65.67	70.97	5,470	615,010	情報技術		
GENERAL MILLS INC	126	136	852	95,801	生活必需品		
FIRSTENERGY CORP	87.68	99.68	324	36,475	公益事業		
GENUINE PARTS CO	33	35	337	37,989	一般消費財・サービス		
IHS MARKIT LTD	-	82.34	293	32,990	資本財・サービス		
FIFTH THIRD BANCORP	175	175	444	49,951	金融		
MEDIVATION INC	34	-	-	-	その他		
HARRIS CORP	25	29.5	308	34,715	情報技術		
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	38	30	140	15,814	資本財・サービス		
HALLIBURTON CO	184	197.5	943	106,107	エネルギー		
HOME DEPOT INC	275	281.5	3,648	410,198	一般消費財・サービス		
ASSURANT INC	16	14	120	13,546	金融		
HUNTINGTON BANCSHARES INC	178	246	302	33,960	金融		
HERSHEY CO/THE	33	33	323	36,404	生活必需品		
HARLEY-DAVIDSON INC	45	45	269	30,312	一般消費財・サービス		
HUMANA INC	32	35	735	82,628	ヘルスケア		
STARWOOD HOTELS & RESORTS	38	-	-	-	その他		
NXP SEMICONDUCTORS NV	-	68	672	75,566	情報技術		
HELMERICH & PAYNE	23	26	175	19,750	エネルギー		
HENRY SCHEIN INC	18	19	291	32,731	ヘルスケア		
HP INC	392	407	616	69,318	情報技術		
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	392	377	894	100,615	情報技術		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	-	45	160	18,095	一般消費財・サービス		
HOLLYFRONTIER CORP	39	39	107	12,074	エネルギー		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	-	21	76	8,555	一般消費財・サービス		
ARCH CAPITAL GROUP LTD	28	28	230	25,934	金融		
HARMAN INTERNATIONAL	14	16	175	19,686	一般消費財・サービス		
KRAFT HEINZ CO/THE	128.03	139.53	1,172	131,762	生活必需品		
INTL BUSINESS MACHINES CORP	199	209.5	3,425	385,145	情報技術		
INTERNATIONAL PAPER CO	86	91	444	49,964	素材		
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	32	36	202	22,744	資本財・サービス		
ZOETIS INC	103	107	539	60,686	ヘルスケア		
INGERSOLL-RAND PLC	57.29	60.29	452	50,874	資本財・サービス		
CHENIERE ENERGY INC	47	47	183	20,590	エネルギー		
LEGGETT & PLATT INC	31	31	150	16,926	一般消費財・サービス		
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	134.23	145.23	451	50,759	一般消費財・サービス		
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	-	24.37	52	5,895	一般消費財・サービス		
WASTE CONNECTIONS INC	-	41.05	315	35,511	資本財・サービス		
JUNIPER NETWORKS INC	75	82	219	24,686	情報技術		
JM SMUCKER CO/THE	24	27.2	346	38,916	生活必需品		
JOHNSON & JOHNSON	591	624	7,018	789,048	ヘルスケア		
ABBVIE INC	367.29	373.79	2,302	258,810	ヘルスケア		
HOLOGIC INC	51	57.5	224	25,197	ヘルスケア		
KIMBERLY-CLARK CORP	77	83.5	972	109,359	生活必需品		
KROGER CO	200	212	701	78,887	生活必需品		
KLA-TENCOR CORP	33	37	302	33,975	情報技術		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
LOCKHEED MARTIN CORP	57	61.5	1,639	184,308	資本財・サービス		
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	17	21	314	35,339	情報技術		
L BRANDS INC	53	56	402	45,296	一般消費財・サービス		
LOWE'S COS INC	203	205	1,449	162,958	一般消費財・サービス		
ELI LILLY & CO	211	227.5	1,527	171,739	ヘルスケア		
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	65	69	387	43,570	電気通信サービス		
LAM RESEARCH CORP	33	37	398	44,744	情報技術		
RANGE RESOURCES CORP	37	43	156	17,581	エネルギー		
JONES LANG LASALLE INC	9	10	101	11,382	不動産		
LOEWS CORP	61	65	288	32,459	金融		
LINCOLN NATIONAL CORP	54.49	54.49	345	38,788	金融		
MCDONALD'S CORP	205	194	2,341	263,196	一般消費財・サービス		
3M CO	135	139	2,401	269,976	資本財・サービス		
FACEBOOK INC-A	456	531.5	6,424	722,213	情報技術		
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	-	52.54	279	31,464	情報技術		
MANPOWERGROUP INC	17	17	144	16,267	資本財・サービス		
S&P GLOBAL INC	58	61.5	735	82,696	金融		
MARTIN MARIETTA MATERIALS	12	14	305	34,389	素材		
CONCHO RESOURCES INC	28	32.5	413	46,521	エネルギー		
PHILLIPS 66	117	110	906	101,885	エネルギー		
MURPHY OIL CORP	36	36	105	11,906	エネルギー		
MGM RESORTS INTERNATIONAL	93	108	311	35,052	一般消費財・サービス		
MATTEL INC	72	78	246	27,674	一般消費財・サービス		
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	25	26.5	246	27,744	生活必需品		
MYLAN NV	87	104.5	376	42,362	ヘルスケア		
METLIFE INC	203	213.5	1,156	130,065	金融		
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	84	105	150	16,974	情報技術		
MOTOROLA SOLUTIONS INC	34.28	36.78	298	33,537	情報技術		
MONSANTO CO	102.06	100.56	1,029	115,751	素材		
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	6	253	28,444	ヘルスケア		
ROCKWELL AUTOMATION INC	28	29.5	387	43,557	資本財・サービス		
MERCK & CO. INC.	598.21	638.71	3,972	446,547	ヘルスケア		
MASCO CORP	74	74	238	26,795	資本財・サービス		
M & T BANK CORP	32.19	33.69	474	53,323	金融		
MARSH & MCLENNAN COS	115	121.5	838	94,219	金融		
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	47.82	75.22	595	66,897	一般消費財・サービス		
WORKDAY INC-CLASS A	22	26.5	222	25,039	情報技術		
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	44	39.5	188	21,186	一般消費財・サービス		
TOWERS WATSON & CO-CL A	15	-	-	-	その他		
VANTIV INC - CL A	33	35.5	205	23,147	情報技術		
FIREEYE INC	22	-	-	-	情報技術		
REALOGY HOLDINGS CORP	32	-	-	-	不動産		
NETAPP INC	67	67	244	27,499	情報技術		
NIKE INC -CL B	146	305.5	1,546	173,885	一般消費財・サービス		
NORFOLK SOUTHERN CORP	65	67.5	704	79,199	資本財・サービス		
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	45	48.5	320	36,001	情報技術		
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	27	30	213	23,979	金融		
NORTH FINANCIAL INC	93	102	196	22,096	金融		
ALLYFRAN GRUMMAN CORP	39	39.5	994	111,814	資本財・サービス		
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	62	62	393	44,217	一般消費財・サービス		
NEWMONT MINING CORP	115	120	402	45,260	素材		
ADT CORP/THE	39.62	-	-	-	その他		
MCKESSON CORP	49	51.5	727	81,778	ヘルスケア		
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	60	64	254	28,599	情報技術		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千ドル			
XYLEM INC	38	42	215	24,240	資本財・サービス		
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	330	358.5	3,248	365,141	生活必需品		
NUCOR CORP	68	71.5	440	49,538	素材		
WESTERN UNION CO	113.46	113.46	240	26,989	情報技術		
NEWELL BRANDS INC	60	101.42	481	54,123	一般消費財・サービス		
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	163	175.5	1,185	133,313	エネルギー		
LIBERTY MEDIA CORP - C	45	—	—	—	その他		
LIBERTY BROADBAND-C	—	26	186	20,995	一般消費財・サービス		
PAYCHEX INC	68	75.5	448	50,467	情報技術		
PATTERSON COS INC	19	19	73	8,302	ヘルスケア		
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21	22	605	68,110	一般消費財・サービス		
ALTRIA GROUP INC	420	450.5	2,936	330,105	生活必需品		
P G & E CORP	102	115	695	78,164	公益事業		
PFIZER INC	1,313.63	1,396.63	4,458	501,173	ヘルスケア		
ALKERMES PLC	32	36	209	23,501	ヘルスケア		
XCEL ENERGY INC	106	115	465	52,346	公益事業		
STRYKER CORP	72	78.5	905	101,848	ヘルスケア		
PARKER HANNIFIN CORP	29	30.5	417	46,957	資本財・サービス		
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	32	37.5	651	73,214	エネルギー		
POLARIS INDUSTRIES INC	14	14	121	13,642	一般消費財・サービス		
PROCTER & GAMBLE CO/THE	577.37	581.67	4,821	542,028	生活必需品		
EXELON CORP	187.22	213.22	717	80,683	公益事業		
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	48	51	640	72,006	ヘルスケア		
CONOCOPHILLIPS	264	286.5	1,267	142,457	エネルギー		
PEPSICO INC	314	327	3,353	376,950	生活必需品		
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	97	102	1,017	114,404	金融		
AMERICAN WATER WORKS CO INC	38	40.5	307	34,593	公益事業		
ACCENTURE PLC-CL A	134	145.5	1,759	197,822	情報技術		
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	22	22	136	15,301	金融		
PENTAIR PLC	40.05	40.05	225	25,308	資本財・サービス		
QUALCOMM INC	348	336.5	2,246	252,586	情報技術		
PARTNERRE LTD	10	—	—	—	その他		
INVESCO LTD	90.5	98.5	304	34,261	金融		
ADVANCE AUTO PARTS INC	15.5	17	288	32,451	一般消費財・サービス		
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	62	66	377	42,433	金融		
ENERGEN CORP	17	—	—	—	エネルギー		
RAYTHEON COMPANY	66	69	1,038	116,773	資本財・サービス		
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	18	18	126	14,177	一般消費財・サービス		
RED HAT INC	39	42	336	37,773	情報技術		
REGENERON PHARMACEUTICALS	16	18.1	700	78,799	ヘルスケア		
REPUBLIC SERVICES INC	53	56.5	315	35,506	資本財・サービス		
PRICELINE GROUP INC/THE	11	11.4	1,733	194,835	一般消費財・サービス		
ROSS STORES INC	88	94	644	72,461	一般消費財・サービス		
PACKAGING CORP OF AMERICA	21	21	179	20,218	素材		
RESMED INC	30	32.5	201	22,692	ヘルスケア		
QUEST DIAGNOSTICS INC	31	33	292	32,925	ヘルスケア		
ROBERT HALF INTL INC	28	28	125	14,061	資本財・サービス		
REYNOLDS AMERICAN INC	184.78	196.78	1,081	121,582	生活必需品		
RITE AID CORP	196	230	185	20,814	生活必需品		
RALPH LAUREN CORP	13	13	141	15,872	一般消費財・サービス		
AUTONATION INC	17	17	75	8,452	一般消費財・サービス		
ROCKWELL COLLINS INC	27	29	267	30,104	資本財・サービス		
REGIONS FINANCIAL CORP	288.35	288.35	380	42,724	金融		
CHEVRON CORP	400.18	433.18	4,736	532,464	エネルギー		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千ドル			
EDISON INTERNATIONAL	69	75	533	59,990	公益事業		
TESLA MOTORS INC	20	26.7	506	56,901	一般消費財・サービス		
SYMANTEC CORP	147	147	357	40,190	情報技術		
ENDO INTERNATIONAL PLC	43	46	74	8,362	ヘルスケア		
STANLEY BLACK & DECKER INC	33.22	34.72	416	46,811	資本財・サービス		
SYNOPSIS INC	34	34	207	23,380	情報技術		
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	18	48.85	1,370	154,037	一般消費財・サービス		
CBRE GROUP INC - A	64	71	207	23,274	不動産		
TWITTER INC	104	130	236	26,583	情報技術		
NAVIENT CORP	87	87	149	16,812	金融		
SANDISK CORP	44	—	—	—	その他		
SOUTHERN CO/THE	196	217.5	1,050	118,124	公益事業		
SYSCO CORP	125	124	668	75,123	生活必需品		
TRAVELERS COS INC/THE	68.23	67.23	764	85,934	金融		
SOUTHWESTERN ENERGY CO	79	110	127	14,332	エネルギー		
SEI INVESTMENTS COMPANY	52	32	151	17,059	金融		
STERICYCLE INC	18	19.5	147	16,623	資本財・サービス		
SCHLUMBERGER LTD	270.67	322.02	2,573	289,322	エネルギー		
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	35	39	144	16,217	資本財・サービス		
AT&T INC	1,304.91	1,414.91	5,586	627,985	電気通信サービス		
SOUTHWEST AIRLINES CO	38	38	179	20,180	資本財・サービス		
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	17	18.3	505	56,846	素材		
SEMPRA ENERGY	50	54	546	61,477	公益事業		
TIFFANY & CO	28	28	225	25,370	一般消費財・サービス		
SEAGATE TECHNOLOGY	70	70	276	31,084	情報技術		
TEXAS INSTRUMENTS INC	223	230	1,711	192,373	情報技術		
SALESFORCE.COM INC	133	147	1,072	120,522	情報技術		
SIGNET JEWELERS LTD	197	17	156	17,548	一般消費財・サービス		
WESTROCK CO	55.3	59.3	301	33,925	素材		
TIME WARNER CABLE	60.53	—	—	—	その他		
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	89.25	217.84	988	111,133	資本財・サービス		
TESORO CORP	28	28.5	234	26,323	エネルギー		
UNION PACIFIC CORP	188	189	1,900	213,684	資本財・サービス		
MARATHON OIL CORP	143	190	284	31,932	エネルギー		
MARATHON PETROLEUM CORP	118	123	565	63,579	エネルギー		
UNITED TECHNOLOGIES CORP	181	182.5	1,986	223,303	資本財・サービス		
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	150	159.5	1,854	208,501	資本財・サービス		
UNUM GROUP	54	54	226	25,508	金融		
SPRINT CORP	177.65	177.65	142	15,977	電気通信サービス		
ANTERO RESOURCES CORP	—	34	84	9,475	エネルギー		
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	19	34.94	282	31,788	ヘルスケア		
VOYA FINANCIAL INC	50	50	189	21,264	金融		
AMEREN CORPORATION	51	55	280	31,490	公益事業		
UNITEDHEALTH GROUP INC	203.26	220.26	3,471	390,218	ヘルスケア		
VERISIGN INC	22	22	174	19,568	情報技術		
VALERO ENERGY CORP	108.92	107.92	688	77,368	エネルギー		
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	13	13.9	361	40,692	一般消費財・サービス		
FNF GROUP	52.38	57.38	187	21,035	金融		
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	20	20	246	27,695	ヘルスケア		
ANTHEM INC	57	60.5	878	98,810	ヘルスケア		
WALT DISNEY CO/THE	343	347	3,458	388,810	一般消費財・サービス		
WELLS FARGO & CO	1,030.72	1,107.72	5,744	645,811	金融		
FOOT LOCKER INC	29	32	231	26,059	一般消費財・サービス		
WASTE MANAGEMENT INC	96	103	725	81,506	資本財・サービス		

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
WILLIAMS COS INC	151	167	483	54,313	エネルギー		
TRACTOR SUPPLY COMPANY	29	31	231	26,050	一般消費財・サービス		
WHITING PETROLEUM CORP	44	-	-	-	エネルギー		
WHIRLPOOL CORP	17	17	278	31,262	一般消費財・サービス		
WAL-MART STORES INC	343	351.5	2,508	282,023	生活必需品		
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	37	46	475	53,471	ヘルスケア		
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	168	195	84	9,470	エネルギー		
WYNN RESORTS LTD	18	18	179	20,193	一般消費財・サービス		
XEROX CORP	229.44	192.44	182	20,465	情報技術		
WABTEC CORP	21	21	177	19,944	資本財・サービス		
TJX COMPANIES INC	145	153.5	1,209	135,998	一般消費財・サービス		
WATERS CORP	18	18	247	27,850	ヘルスケア		
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	20	20	139	15,675	資本財・サービス		
ALLERGAN PLC	83.07	90.57	1,744	196,143	ヘルスケア		
WHOLE FOODS MARKET INC	78	78	238	26,841	生活必需品		
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	186	212.5	1,817	204,324	生活必需品		
WILLIS TOWERS WATSON PLC	34	30.83	383	43,108	金融		
WESTERN DIGITAL CORP	49	64.5	404	45,442	情報技術		
WEC ENERGY GROUP INC	67.3	73.8	428	48,145	公益事業		
WESTAR ENERGY INC	-	32	182	20,544	公益事業		
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	109	117.5	503	56,588	公益事業		
VISA INC-CLASS A SHARES	417	429.5	3,399	382,170	情報技術		
PPL CORP	143	154	526	59,192	公益事業		
PEPCO HOLDINGS INC	56	-	-	-	その他		
PULTEGROUP INC	74	74	142	16,047	一般消費財・サービス		
PPG INDUSTRIES INC	58	61.5	602	67,755	素材		
NORTHERN TRUST CORP	49	49	397	44,696	金融		
PRECISION CASTPARTS CORP	30	-	-	-	その他		
NVIDIA CORP	116.5	124	1,156	129,991	情報技術		
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	110.93	113.93	1,244	139,940	金融		
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	95.5	95.5	205	23,093	一般消費財・サービス		
TERADATA CORP	32	-	-	-	情報技術		
TYSON FOODS INC-CL A	65	69	406	45,735	生活必需品		
NETFLIX INC	86	98	1,151	129,462	一般消費財・サービス		
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	85	90.5	1,278	143,728	ヘルスケア		
NRG ENERGY INC	71	-	-	-	公益事業		
TORCHMARK CORP	26.75	26.75	186	20,951	金融		
FIRST REPUBLIC BANK/CA	31	34	277	31,163	金融		
TEXTRON INC	59	63.5	291	32,823	資本財・サービス		
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	266.5	249.5	710	79,854	一般消費財・サービス		
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	96	103	292	32,838	一般消費財・サービス		
NEWS CORP - CLASS A	83.37	83.37	96	10,815	一般消費財・サービス		
OGE ENERGY CORP	42	47	151	17,045	公益事業		
OMNICOM GROUP	53	55	485	54,621	一般消費財・サービス		
ORACLE CORP	731.83	702.83	2,849	320,394	情報技術		
MASTERCARD INC - A	214	224.5	2,330	262,023	情報技術		
ONEOK INC	46	49	256	28,886	エネルギー		
OCEANEERING INTL INC	21	-	-	-	エネルギー		
CENTURYLINK INC	120.95	127.95	309	34,824	電気通信サービス		
ROPER TECHNOLOGIES INC	21	23	416	46,826	資本財・サービス		
YUM! BRANDS INC	92	83	527	59,288	一般消費財・サービス		
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	13	14	320	35,996	情報技術		
MOLSON COORS BREWING CO-B	33	44	440	49,489	生活必需品		
NOBLE ENERGY INC	89	101	350	39,365	エネルギー		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
BANK OF AMERICA CORP	2,223.01	2,325.01	4,717	530,335	金融		
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	34	38	329	37,037	ヘルスケア		
NORDSTROM INC	30	30	169	19,004	一般消費財・サービス		
AMERICAN EXPRESS CO	195	178	1,272	143,056	金融		
ANALOG DEVICES INC	67	70	521	58,656	情報技術		
TD AMERITRADE HOLDING CORP	60	60	243	27,405	金融		
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	285.72	243.22	1,539	173,025	金融		
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	14	14	160	18,009	素材		
ANADARKO PETROLEUM CORP	109	127	764	85,892	エネルギー		
SKYWORKS SOLUTIONS INC	41	44	339	38,196	情報技術		
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	38	40.5	335	37,753	一般消費財・サービス		
NEWFIELD EXPLORATION CO	-	45	175	19,780	エネルギー		
MALLINCKRODT PLC	25	25	131	14,732	ヘルスケア		
AVERY DENNISON CORP	19	21	153	17,222	素材		
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	131	141.5	787	88,493	情報技術		
EMERSON ELECTRIC CO	141	148.5	807	90,817	資本財・サービス		
AON PLC	60	62	704	79,214	金融		
AMGEN INC	162	174	2,540	285,591	ヘルスケア		
CORE LABORATORIES N.V.	10	10	106	11,933	エネルギー		
COACH INC	59	64	239	26,908	一般消費財・サービス		
EATON CORP PLC	100.86	104.36	685	77,068	資本財・サービス		
CELGENE CORP	169	179	2,186	245,764	ヘルスケア		
CONSTELLATION BRANDS INC-A	37	41.2	641	72,161	生活必需品		
APPLIED MATERIALS INC	260	245	787	88,577	情報技術		
CIT GROUP INC	39	45	180	20,316	金融		
CIMAREX ENERGY CO	19	22.5	278	31,362	エネルギー		
CME GROUP INC	69	78	878	98,797	金融		
NATIONAL OILWELL VARCO INC	82.44	88.44	306	34,400	エネルギー		
ECOLAB INC	58	61.5	715	80,483	素材		
EQUIFAX INC	26	27.5	328	36,888	資本財・サービス		
GAP INC/THE	50	58	146	16,457	一般消費財・サービス		
GILEAD SCIENCES INC	311	306	2,291	257,556	ヘルスケア		
ST JUDE MEDICAL INC	59	64.5	514	57,791	ヘルスケア		
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	41.48	43.98	393	44,226	生活必需品		
HORMEL FOODS CORP	32	68.5	242	27,314	生活必需品		
STATE STREET CORP	89.43	91.93	707	79,588	金融		
STAPLES INC	136	156	153	17,204	一般消費財・サービス		
SUNTRUST BANKS INC	110.48	115.98	593	66,678	金融		
SCHWAB (CHARLES) CORP	252	274	1,053	118,468	金融		
IHS INC-CLASS A	15	-	-	-	その他		
BAXTER INTERNATIONAL INC	116	114	510	57,363	ヘルスケア		
B/E AEROSPACE INC	23	23	137	15,490	資本財・サービス		
CAMPBELL SOUP CO	40	46	265	29,812	生活必需品		
CROWN HOLDINGS INC	31	31	172	19,390	素材		
CHUBB CORP	49	-	-	-	その他		
CARDINAL HEALTH INC	71	75.5	535	60,254	ヘルスケア		
FEDEX CORP	57	58.5	1,113	125,165	資本財・サービス		
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	116.54	114.04	941	105,896	金融		
FMC CORP	28	32	175	19,713	素材		
FLEX LTD	122	122	177	19,941	情報技術		
CERNER CORP	66	70	348	39,166	ヘルスケア		
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	18	18	218	24,535	素材		
CITRIX SYSTEMS INC	34	36.5	320	36,084	情報技術		
INTEL CORP	1,004	1,084	3,827	430,299	情報技術		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
CAMERON INTERNATIONAL CORP	41	—	—	—	—	—	その他
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	88	88	214	24,079	—	—	一般消費財・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	92	91	426	48,000	—	—	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	70	74	929	104,495	—	—	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	553	450	207	23,321	—	—	一般消費財・サービス
ILLUMINA INC	30	33.5	457	51,418	—	—	ヘルスケア
CHESAPEAKE ENERGY CORP	119	—	—	—	—	—	エネルギー
SEALED AIR CORP	44	44	206	23,243	—	—	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	8	8.7	565	63,603	—	—	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	—	31	252	28,434	—	—	情報技術
SNAP-ON INC	12	13	218	24,524	—	—	資本財・サービス
CALPINE CORP	72	72	83	9,332	—	—	公益事業
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	43	—	—	—	—	—	その他
CARMAX INC	46	46	264	29,740	—	—	一般消費財・サービス
COMERICA INC	40	40	247	27,767	—	—	金融
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	23	—	—	—	—	—	資本財・サービス
INGREDION INC	—	16	192	21,624	—	—	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	148.28	158.28	1,208	135,891	—	—	公益事業
TARGET CORP	130	129	1,011	113,711	—	—	一般消費財・サービス
DOVER CORP	35	35	244	27,456	—	—	資本財・サービス
VWV GRAINGER INC	13	13	294	33,080	—	—	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	26	29	178	20,121	—	—	資本財・サービス
JOHNSON CONTROLS INC	142	—	—	—	—	—	その他
CINTAS CORP	21	21	242	27,286	—	—	資本財・サービス
CA INC	71.05	71.05	230	25,943	—	—	情報技術
CONAGRA BRANDS INC	90	95	358	40,284	—	—	生活必需品
CLOROX COMPANY	28	29.5	347	39,030	—	—	生活必需品
ENTERGY CORP	38	42.5	303	34,113	—	—	公益事業
MICROSOFT CORP	1,614	1,693.5	10,345	1,163,051	—	—	情報技術
INCYTE CORP	34	38.5	404	45,476	—	—	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	239.74	247.24	1,876	210,906	—	—	生活必需品
MEDTRONIC PLC	301.88	316.38	2,322	261,136	—	—	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	230	241	468	52,615	—	—	情報技術
BLACKROCK INC	26	28.5	1,050	118,082	—	—	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	91	91	219	24,644	—	—	公益事業
HASBRO INC	24	26	225	25,318	—	—	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	56	61	449	50,485	—	—	生活必需品
KEYCORP	184	245	416	46,850	—	—	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	24	24	211	23,729	—	—	資本財・サービス
MONSIEUR INTERNATIONAL INC-A	347.11	356.11	1,526	171,585	—	—	生活必需品
KOHL'S CORP	44	44	238	26,780	—	—	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	10	11	187	21,041	—	—	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	100	111	176	19,878	—	—	金融
APACHE CORP	81.1	87.6	532	59,816	—	—	エネルギー
CHUBB LTD	70	107.99	1,384	155,686	—	—	金融
ARROW ELECTRONICS INC	20	20	136	15,379	—	—	情報技術
ALLSTATE CORP	89	87	605	68,101	—	—	金融
EBAY INC	237	250	712	80,127	—	—	情報技術
PAYPAL HOLDINGS INC	234	249.5	995	111,886	—	—	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	32	35	257	28,994	—	—	素材
XILINX INC	56	59.5	321	36,127	—	—	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	155.1	143.1	1,099	123,647	—	—	ヘルスケア
DISH NETWORK CORP-A	47	53	305	34,373	—	—	一般消費財・サービス
YAHOO! INC	193	210	873	98,210	—	—	情報技術

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	49	51.5	404	45,512	—	—	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	38	38	116	13,076	—	—	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	54	59	167	18,797	—	—	情報技術
LINEAR TECHNOLOGY CORP	53	56	350	39,391	—	—	情報技術
LENNAR CORP-A	39	44	194	21,883	—	—	一般消費財・サービス
LEAR CORP	17	17	217	24,474	—	—	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	57	65	221	24,895	—	—	金融
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	83	—	—	—	—	—	資本財・サービス
PROGRESSIVE CORP	128	134	449	50,585	—	—	金融
PRAXAIR INC	62	66	806	90,654	—	—	素材
PACCAR INC	76.37	79.87	489	55,014	—	—	資本財・サービス
PVH CORP	17	19	201	22,647	—	—	一般消費財・サービス
EMC CORP/MA	411	—	—	—	—	—	その他
BIOGEN INC	50.3	50.8	1,538	172,910	—	—	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	—	20	240	27,057	—	—	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	321	336	1,954	219,726	—	—	一般消費財・サービス
PERRIGO CO PLC	31	34	291	32,791	—	—	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	66.8	74.8	402	45,198	—	—	公益事業
INTUIT INC	57	56	650	73,128	—	—	情報技術
BORGWARNER INC	48	48	165	18,595	—	—	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	65	71	323	36,413	—	—	一般消費財・サービス
BALL CORP	28	37.92	292	32,846	—	—	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	288.47	310.47	644	72,493	—	—	ヘルスケア
BED BATH & BEYOND INC	36	36	162	18,236	—	—	一般消費財・サービス
XL GROUP LTD	63	68	248	27,894	—	—	金融
ELECTRONIC ARTS INC	68	70.5	573	64,490	—	—	情報技術
VULCAN MATERIALS CO	29	30.5	384	43,247	—	—	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	52	56.5	483	54,402	—	—	ヘルスケア
VF CORP	71	77.5	431	48,467	—	—	一般消費財・サービス
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	94.71	94.71	577	64,948	—	—	一般消費財・サービス
VIACOM INC-CLASS B	72.71	81.71	301	33,941	—	—	一般消費財・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	13	15	300	33,742	—	—	一般消費財・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	60	52	84	9,540	—	—	情報技術
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	22	22	200	22,595	—	—	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	87	80.5	428	48,163	—	—	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	452.7	545.7	3,827	430,292	—	—	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	84	—	—	—	—	—	その他
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	—	58	311	35,059	—	—	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	265	166	18,679	—	—	不動産
アメリカ・ドル 通貨計	67,034.73	71,134.09	445,578	50,091,912	—	—	株数、金額 銘柄数<比率> <63.4%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	—	—	—
IMPERIAL OIL LTD	66	72	318	26,642	—	—	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4	4.4	277	23,247	—	—	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	30	46.96	142	11,965	—	—	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	43.87	53.87	350	29,296	—	—	一般消費財・サービス
SILVER WHEATON CORP	90	107	268	22,473	—	—	素材
INTACT FINANCIAL CORP	29	31.5	292	24,461	—	—	金融
BCE INC	34.3	34.3	200	16,793	—	—	電気通信サービス
FRANCO-NEVADA CORP	35	43	342	28,623	—	—	素材
SUNCOR ENERGY INC	318.8	393.3	1,586	132,797	—	—	エネルギー
METRO INC	55	55	225	18,892	—	—	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	70	77	386	32,307	—	—	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	266	282	2,078	173,915	—	—	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千カナダ・ドル	千円			
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	87	91.5	969	81,168	金融		
TORONTO-DOMINION BANK	404	437	2,800	234,365	金融		
GREAT-WEST LIFECO INC	67	67	238	19,970	金融		
MEG ENERGY CORP	38	-	-	-	エネルギー		
ROYAL BANK OF CANADA	315	348.5	3,140	262,812	金融		
TOURMALINE OIL CORP	38	47	164	13,737	エネルギー		
VERMILION ENERGY INC	25	25	128	10,725	エネルギー		
TRANSCANADA CORP	154	189.5	1,145	95,873	エネルギー		
PEMBINA PIPELINE CORP	75	94	361	30,275	エネルギー		
BOMBARDIER INC-B	366	454	86	7,218	資本財・サービス		
BARRICK GOLD CORP	245	273	566	47,402	素材		
CAE INC	74	58	114	9,604	資本財・サービス		
THOMSON REUTERS CORP	78.04	78.04	454	38,046	金融		
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	178	202	476	39,858	素材		
EMPIRE CO LTD 'A'	39	39	71	5,991	生活必需品		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	14	14	67	5,664	素材		
VERESEN INC	62	80	95	8,013	エネルギー		
CCL INDUSTRIES INC - CL B	-	6.9	162	13,565	素材		
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	-	97	109	9,131	金融		
LINAMAR CORP	-	11	56	4,703	一般消費財・サービス		
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	-	54	156	13,104	エネルギー		
HYDRO ONE LTD	-	40	92	7,755	公益事業		
LOBLAW COMPANIES LTD	48.6	51.6	360	30,186	生活必需品		
CANADIAN UTILITIES LTD-A	28	28	99	8,336	公益事業		
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	81	86	451	37,795	電気通信サービス		
AGNICO EAGLE MINES LTD	48	51	287	24,056	素材		
KINROSS GOLD CORP	295	295	133	11,157	素材		
BANK OF MONTREAL	143	152	1,354	113,380	金融		
POWER CORP OF CANADA	80	87	260	21,833	金融		
METHANEX CORP	22	22	120	10,066	素材		
CAMECO CORP	92	92	112	9,392	エネルギー		
TELUS CORP	54	54	229	19,163	電気通信サービス		
POWER FINANCIAL CORP	56	56	188	15,782	金融		
TECK RESOURCES LTD-CLS B	121	134	453	37,933	素材		
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	17	17	241	20,216	一般消費財・サービス		
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	208	208	95	8,023	素材		
AGRIUM INC	29	31	409	34,231	素材		
CANADIAN NATURAL RESOURCES	243	255	1,062	88,917	エネルギー		
FAIRFAX FINANCIAL HDGS LTD	4.5	5.4	343	28,784	金融		
MAGNA INTERNATIONAL INC	89	93	508	42,545	一般消費財・サービス		
WESTON (GEORGE) LTD	11	11	123	10,314	生活必需品		
BLACKBERRY LTD	119	119	119	9,957	情報技術		
SUN LIFE FINANCIAL INC	132	142.5	732	61,327	金融		
ENBRIDGE INC	189	220	1,247	104,364	エネルギー		
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	190	205.5	928	77,709	金融		
MANULIFE FINANCIAL CORP	425	469	1,082	90,618	金融		
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	71	71	163	13,694	ヘルスケア		
GOLDCORP INC	177.59	199.59	360	30,146	素材		
ENCANA CORP	184	232	352	29,528	エネルギー		
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	34	34	680	56,956	資本財・サービス		
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	28	22	122	10,289	金融		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	52	52	193	16,217	一般消費財・サービス		
CANADIAN NATL RAILWAY CO	176	183.5	1,647	137,844	資本財・サービス		
CGI GROUP INC - CLASS A	49	53	347	29,049	情報技術		

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千カナダ・ドル	千円			
HUSKY ENERGY INC	74	75.58	111	9,297	エネルギー		
ONEX CORPORATION	20	20	189	15,835	金融		
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	87	95	252	21,098	一般消費財・サービス		
FINNING INTERNATIONAL INC	39	39	101	8,485	資本財・サービス		
SNC-LAVALIN GROUP INC	34	34	190	15,981	資本財・サービス		
ELDORADO GOLD CORP	172	172	62	5,224	素材		
IGM FINANCIAL INC	23	23	86	7,236	金融		
OPEN TEXT CORP	28	28	238	19,955	情報技術		
CI FINANCIAL CORP	48	54	144	12,069	金融		
SAPUTO INC	58	58	270	22,670	生活必需品		
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	147	171	249	20,891	素材		
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	90	98	629	52,672	生活必需品		
YAMANA GOLD INC	201	233	93	7,818	素材		
YAMANA GOLD INC-RTS	-	14.56	0	40	その他		
FORTIS INC	61	96	392	32,880	公益事業		
CRESCENT POINT ENERGY CORP	105	133	202	16,916	エネルギー		
CENOVUS ENERGY INC	183	196	371	31,096	エネルギー		
DOLLARAMA INC	27	27	278	23,303	一般消費財・サービス		
ARC LTD -CLASS I	-	17	73	6,130	公益事業		
ALTAGAS LTD	31	39	125	10,469	エネルギー		
FIRST CAPITAL REALTY INC	-	26	52	4,394	不動産		
KEYERA CORP	40	40	149	12,481	エネルギー		
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	34	39	126	10,560	エネルギー		
INTER PIPELINE LTD	74	81	219	18,409	エネルギー		
CANADIAN OIL SANDS LTD	112	-	-	-	その他		
ARC RESOURCES LTD	75	83	184	15,433	エネルギー		
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	8,560.7 84銘柄	9,531 90銘柄	37,543 < 4.0%>	3,141,605		
(オーストラリア)	株数	株数	千オーストラリア・ドル	千円			
HEALTHSCOPE LTD	-	375	86	7,257	ヘルスケア		
MEDIBANK PRIVATE LTD	545	617	160	13,497	金融		
BHP BILLITON LIMITED	702	752	1,914	161,093	素材		
SOUTH32 LTD	1,182	1,272	356	29,967	素材		
LENDFLEASE GROUP	121	121	164	13,856	不動産		
ASCIANO LTD	216	-	-	-	その他		
ALUMINA LTD	699	699	118	9,968	素材		
WOODSIDE PETROLEUM LTD	161	182	552	46,461	エネルギー		
FORTESCUE METALS GROUP LTD	397	397	246	20,710	素材		
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	118	118	141	11,934	金融		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	570	620	1,783	150,031	金融		
WESTPAC BANKING CORP	679.98	780.98	2,436	205,020	金融		
SANTOS LTD	220	340	137	11,586	エネルギー		
AUSNET SERVICES	-	410	60	5,122	公益事業		
AUST AND NZ BANKING GROUP	602	689	1,935	162,844	金融		
RIO TINTO LTD	97	97	585	49,287	金融		
ORIGIN ENERGY LTD	364	414	250	21,039	エネルギー		
AMCOR LIMITED	267	267	387	32,597	素材		
AURIZON HOLDINGS LTD	468	468	235	19,846	資本財・サービス		
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	-	100	43	3,660	電気通信サービス		
OIL SEARCH LTD	-	329	217	18,325	エネルギー		
SEEK LTD	75	75	110	9,320	資本財・サービス		
TREASURY WINE ESTATES LTD	146	171	185	15,639	生活必需品		
NEWCREST MINING LTD	176	176	343	28,862	素材		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千円	千円			
INCITEC PIVOT LTD	456	456	147	12,392	素材		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	370	401	3,118	262,363	金融		
CALTEX AUSTRALIA LTD	60	60	179	15,119	エネルギー		
ORICA LTD	83	83	145	12,200	素材		
QBE INSURANCE GROUP LTD	306	328	364	30,633	金融		
CIMIC GROUP LTD	29	29	90	7,630	資本財・サービス		
WOOLWORTHS LTD	281	300	691	58,182	生活必需品		
COCA-COLA AMATIL LTD	137	137	131	11,100	生活必需品		
TABCORP HOLDINGS LTD	205	205	96	8,089	一般消費財・サービス		
CROWN RESORTS LTD	106	106	122	10,328	一般消費財・サービス		
QANTAS AIRWAYS LTD	145.54	145.54	46	3,894	資本財・サービス		
TELSTRA CORP LTD	936	986	496	41,812	電気通信サービス		
AMP LTD	665	665	315	26,577	金融		
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	114	114	237	19,970	素材		
MACQUARIE GROUP LTD	64.84	72.84	605	50,942	金融		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	-	126	187	15,754	一般消費財・サービス		
BANK OF QUEENSLAND LTD	-	91	102	8,598	金融		
CSL LTD	103	106	1,048	88,198	ヘルスケア		
WESFARMERS LTD	244.45	267.45	1,124	94,626	生活必需品		
COCHLEAR LTD	17	14	165	13,958	ヘルスケア		
SUNCORP GROUP LTD	287	312	389	32,762	金融		
BORAL LTD	227	227	113	9,588	素材		
BORAL LTD-RTS	-	102.25	2	219	その他		
ASX LTD	42	42	203	17,139	金融		
COMPUTERSHARE LTD	139	139	163	13,718	情報技術		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	140	65	5,536	一般消費財・サービス		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	511	549	309	26,006	金融		
SONIC HEALTHCARE LTD	95	95	206	17,393	ヘルスケア		
TRANSURBAN GROUP	424	478	499	42,028	資本財・サービス		
TRANSURBAN GROUP-RIGHTS	23.55	-	-	-	その他		
ILUKA RESOURCES LTD	120	-	-	-	素材		
CHALLENGER LTD	-	122	130	11,014	金融		
SYDNEY AIRPORT	251	251	156	13,199	資本財・サービス		
TATTS GROUP LTD	369	369	155	13,071	一般消費財・サービス		
AGL ENERGY LTD	152	152	318	26,793	公益事業		
BRAMBLES LTD	349	373	444	37,409	資本財・サービス		
APA GROUP	242	267	213	17,927	公益事業		
DUET GROUP	-	500	119	10,012	公益事業		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	29	33	236	19,908	ヘルスケア		
TPG TELECOM LTD	-	65	45	3,828	電気通信サービス		
REA GROUP LTD	-	12	61	5,214	一般消費財・サービス		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	-	14	95	8,034	一般消費財・サービス		
オーストラリア・ドル 通貨計	株数、金額 54銘柄	18,405.06 63銘柄	-25,803	2,171,113	< 2.7% >		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円			
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	300	330	2,413	35,002	公益事業		
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	520	550	2,068	29,986	一般消費財・サービス		
MTR CORP	320	345	1,338	19,409	資本財・サービス		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	380	350	3,514	50,953	不動産		
SINO LAND CO	880	880	1,022	14,827	不動産		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	586.69	631.69	5,963	86,465	資本財・サービス		
WHARF HOLDINGS LTD	290	320	1,760	25,520	不動産		
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	125	125	963	13,974	不動産		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千香港ドル	千円			
CLP HOLDINGS LTD	410	425	3,240	46,989	公益事業		
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	330	330	343	4,985	資本財・サービス		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	258.06	283.86	1,216	17,636	不動産		
HONG KONG & CHINA GAS	1,494.93	1,811.42	2,626	38,085	公益事業		
HONG SENG BANK LTD	168	179	2,620	37,998	金融		
WHEELLOCK & CO LTD	250	250	1,076	15,605	不動産		
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,130	1,290	1,104	16,011	不動産		
WH GROUP LTD	-	1,350	854	12,390	生活必需品		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	245	273	5,558	80,595	金融		
LI & FUNG LTD	1,320	1,320	447	6,488	一般消費財・サービス		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	520	520	895	12,983	不動産		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	65	65	487	7,068	情報技術		
YUE YUEN INDUSTRIAL HDG	210	210	582	8,449	一般消費財・サービス		
NWVS HOLDINGS LTD	465	465	641	9,304	資本財・サービス		
KERRY PROPERTIES LTD	180	180	376	5,454	不動産		
BANK OF EAST ASIA LTD	290.4	290.4	939	13,621	金融		
HYSAN DEVELOPMENT CO	-	140	469	6,800	不動産		
SJM HOLDINGS LTD	470	470	289	4,204	一般消費財・サービス		
SWIRE PROPERTIES LTD	300	300	676	9,809	不動産		
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	596.69	641.69	3,333	48,336	不動産		
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	150	150	979	14,202	公益事業		
PCCW LTD	-	950	424	6,157	電気通信サービス		
AIA GROUP LTD	2,628	2,830	13,315	193,069	金融		
SANDS CHINA LTD	540	572	2,225	32,263	一般消費財・サービス		
SHANGRI-LA ASIA LTD	300	300	257	3,736	一般消費財・サービス		
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	315	315	937	13,588	一般消費財・サービス		
MGM CHINA HOLDINGS LTD	200	200	340	4,930	一般消費財・サービス		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	825	875	2,537	36,793	金融		
WYNN MACAU LTD	380	380	529	7,680	一般消費財・サービス		
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	570	570	566	8,215	電気通信サービス		
香港ドル 通貨計	株数、金額 35銘柄	21,468.06 38銘柄	-68,937	999,599	< 1.3% >		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円			
UNITED OVERSEAS BANK LTD	290	300	602	47,571	金融		
DBS GROUP HOLDINGS LTD	385	415	720	56,860	金融		
SINGAPORE AIRLINES LTD	124.7	124.7	122	9,709	資本財・サービス		
KEPPEL CORP LTD	315	345	185	14,684	資本財・サービス		
UOL GROUP LTD	132	132	76	6,045	不動産		
CITY DEVELOPMENTS LTD	112	112	92	7,323	不動産		
CAPITALAND LTD	590	590	178	14,117	不動産		
SEMPACORP MARINE LTD	250	-	-	-	資本財・サービス		
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	410	410	152	12,044	一般消費財・サービス		
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30	30	118	9,369	一般消費財・サービス		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	670	742	669	52,853	金融		
GENTING SINGAPORE PLC	1,530	1,530	147	11,659	一般消費財・サービス		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,750.5	1,886.5	711	56,164	電気通信サービス		
NOBLE GROUP LTD	1,151.81	-	-	-	資本財・サービス		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	350	350	115	9,148	資本財・サービス		
SEMPACORP INDUSTRIES LTD	290	290	79	6,252	資本財・サービス		
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	2,194	2,194	95	7,536	生活必需品		
SINGAPORE EXCHANGE LTD	190	190	136	10,773	金融		
COMFORTDELGRO CORP LTD	468	468	117	9,239	資本財・サービス		
STARHUB LTD	-	160	45	3,626	電気通信サービス		

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千ドル			
WILMAR INTERNATIONAL LTD	560	560	199	15,743	生活必需品		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	690	690	140	11,115	不動産		
シンガポール・ドル 通貨計	12,483.01 21銘柄	11,519.2 20銘柄	4,708 < 0.5% >	371,840			
(ニュージーランド)	株数	株数	千円	千ドル			
MERIDIAN ENERGY LTD	—	260	66	5,362	公益事業		
SPARK NEW ZEALAND LTD	526.89	526.89	184	14,841	電気通信サービス		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	234	234	142	11,454	資本財・サービス		
CONTACT ENERGY LTD	130	130	61	4,934	公益事業		
FLETCHER BUILDING LTD	201	201	217	17,420	素材		
RYMAN HEALTHCARE LTD	—	53	45	3,632	ヘルスケア		
ニュージーランド・ドル 通貨計	1,091.89 4銘柄	1,404.89 6銘柄	718 < 0.1% >	57,646			
(イギリス)	株数	株数	千円	千ドル			
MERLIN ENTERTAINMENT	141	163	71	10,057	一般消費財・サービス		
TUI AG-DI	107.47	117.47	123	17,374	一般消費財・サービス		
BP PLC	3,979	4,363	1,930	271,206	エネルギー		
UNILEVER PLC	277.6	301.1	942	132,375	生活必需品		
BARCLAYS PLC	3,657	3,975	851	119,621	金融		
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	394	434	292	41,025	資本財・サービス		
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL	36,523.8	—	—	—	その他		
MARKS & SPENCER GROUP PLC	353	381	125	17,569	一般消費財・サービス		
RANDGOLD RESOURCES LTD	19	23	134	18,882	素材		
REXAM PLC	151.6	—	—	—	その他		
PRUDENTIAL PLC	563	602	930	130,767	金融		
INMARSAT PLC	94	103	74	10,438	電気通信サービス		
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	681.91	792.91	156	21,940	金融		
JOHNSON MATTHEY PLC	44.09	45.64	143	20,135	素材		
BAE SYSTEMS PLC	677	761	457	64,294	資本財・サービス		
AVIVA PLC	883.66	939.66	424	59,617	金融		
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,061.02	1,150.02	1,734	243,589	ヘルスケア		
MELROSE INDUSTRIES PLC	240.42	—	—	—	資本財・サービス		
WORLDPAY GROUP PLC	—	427	115	16,283	情報技術		
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	80	56	7,893	ヘルスケア		
AUTO TRADER GROUP PLC	—	252	101	14,264	情報技術		
DCC PLC	—	20	122	17,136	資本財・サービス		
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	—	19,964	1	280	その他		
ROYAL MAIL PLC	171	224	104	14,617	資本財・サービス		
RELX PLC	247.46	256.46	353	49,674	資本財・サービス		
BG GROUP PLC	744	—	—	—	その他		
DIAGEO PLC	549	594	1,194	167,825	生活必需品		
RIO TINTO PLC	276	291.5	894	125,575	素材		
STANDARD CHARTERED PLC	557	783	494	69,430	金融		
TESCO PLC	1,753	1,911	399	56,059	生活必需品		
FRESNILLO PLC	50	50	61	8,666	素材		
SMITH & NEPHEW PLC	193	215	242	34,064	ヘルスケア		
GLENCORE PLC	2,369.25	2,909.25	818	114,968	素材		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	57	57	67	9,503	金融		
SMITHS GROUP PLC	84.33	93.33	130	18,352	資本財・サービス		
BABCOCK INTL GROUP PLC	61	61	57	8,118	資本財・サービス		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	298.83	339.83	119	16,806	金融		
DIXONS CARPHONE PLC	209	248	83	11,683	一般消費財・サービス		
PEARSON PLC	173.63	188.63	146	20,626	一般消費財・サービス		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千ドル			
SAINSBURY (J) PLC	285.25	381.25	88	12,487	生活必需品		
NEXT PLC	31	33	162	22,893	一般消費財・サービス		
TAYLOR WIMPEY PLC	689	739	110	15,507	一般消費財・サービス		
WHITBREAD PLC	40.11	43.11	150	21,084	一般消費財・サービス		
IMI PLC	58.5	58.5	56	7,871	資本財・サービス		
BUNZL PLC	72.55	77.55	159	22,438	資本財・サービス		
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	206	206	55	7,748	金融		
GKN PLC	365	406	125	17,587	一般消費財・サービス		
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	55	—	—	—	一般消費財・サービス		
VODAFONE GROUP PLC	5,773.83	6,261.83	1,216	170,849	電気通信サービス		
CRODA INTERNATIONAL PLC	31	29.93	98	13,797	素材		
KINGFISHER PLC	519.11	519.11	185	26,066	一般消費財・サービス		
WPP PLC	282	298	512	71,994	一般消費財・サービス		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	147.27	159.27	143	20,201	公益事業		
SEVERN TRENT PLC	51.33	57.33	127	17,884	公益事業		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	139	149	1,007	141,539	生活必需品		
ST JAMES'S PLACE PLC	110	119	112	15,828	金融		
SCHRODERS PLC	27	32	89	12,531	金融		
TATE & LYLE PLC	101	101	69	9,703	生活必需品		
AMEC FOSTER WHEELER PLC	86	—	—	—	エネルギー		
SSE PLC	214	238	355	49,876	公益事業		
WEIR GROUP PLC/THE	48	48	83	11,717	資本財・サービス		
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	212	227	108	15,180	一般消費財・サービス		
ASTRAZENECA PLC	276	298	1,265	177,725	ヘルスケア		
WOLSELEY PLC	56.15	59.65	275	38,708	資本財・サービス		
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,306	1,436	343	48,186	金融		
3I GROUP PLC	210.91	229.91	154	21,717	金融		
SKY PLC	222	248	192	26,978	一般消費財・サービス		
SHTEAD GROUP PLC	112	122	184	25,892	資本財・サービス		
SAGE GROUP PLC/THE	241.14	261.14	176	24,777	情報技術		
NATIONAL GRID PLC	813.28	888.28	824	115,797	公益事業		
LLYODS BANKING GROUP PLC	12,469.65	15,039.65	867	121,910	金融		
RSA INSURANCE GROUP PLC	217.6	242.6	130	18,349	金融		
IMPERIAL BRANDS PLC	207	226.5	796	111,922	生活必需品		
CENTRICA PLC	1,071.6	1,283.6	269	37,825	公益事業		
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	—	30	75	10,606	一般消費財・サービス		
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	36.5	108	15,200	金融		
ARM HOLDINGS PLC	305	—	—	—	その他		
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	406.6	435.6	1,940	272,545	生活必需品		
ICAP PLC	120	120	58	8,191	金融		
SABMILLER PLC	210	—	—	—	その他		
BHP BILLITON PLC	455.77	501.77	659	92,573	素材		
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	77	85	217	30,528	生活必需品		
HSBC HOLDINGS PLC	4,255	4,633	2,927	411,144	金融		
SHIRE PLC	128	210.74	994	139,744	ヘルスケア		
OLD MUTUAL PLC	1,040.25	1,170.25	221	31,148	金融		
ANGLO AMERICAN PLC	298.83	334.83	403	56,647	素材		
MONDI PLC	75	83	135	19,037	素材		
WM MORRISON SUPERMARKETS	509	509	112	15,743	生活必需品		
CARNIVAL PLC	41.61	45.11	186	26,161	一般消費財・サービス		
EASYJET PLC	35	35	35	4,970	資本財・サービス		
COMPASS GROUP PLC	366.41	388.41	540	75,942	一般消費財・サービス		
PERSIMMON PLC	68	75.5	130	18,282	一般消費財・サービス		
BT GROUP PLC	1,826	2,000	708	99,544	電気通信サービス		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
COCA-COLA HBC AG-DI	百株	百株	44	44	73	10,351	生活必需品
WILLIAM HILL PLC	192	192	58	58	8,147	14,717	一般消費財・サービス
BURBERRY GROUP PLC	95.89	104.89	147	147	20,743	20,743	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP AG	50.73	44.77	148	148	20,915	20,915	一般消費財・サービス
AGGREKO PLC	54.68	—	—	—	—	—	資本財・サービス
CAPITA PLC	142.9	150.9	84	84	11,816	11,816	資本財・サービス
TRAVIS PERKINS PLC	53	59	80	80	11,353	11,353	資本財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	35	38	123	123	17,346	17,346	資本財・サービス
ITV PLC	825	868	148	148	20,872	20,872	一般消費財・サービス
PETROFAC LTD	56	56	43	43	6,056	6,056	エネルギー
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	66.49	75.49	209	209	29,434	29,434	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	849	1,000	1,949	1,949	273,756	273,756	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	533.81	881.18	1,790	1,790	251,439	251,439	エネルギー
MEGGITT PLC	177	177	83	83	11,719	11,719	資本財・サービス
G4S PLC	346	346	82	82	11,654	11,654	資本財・サービス
COBHAM PLC	256	386	63	63	8,935	8,935	資本財・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	33	55	55	7,736	7,736	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	—	52	98	98	13,870	13,870	金融
INVESTEC PLC	123	145	75	75	10,621	10,621	金融
ANTOFAGASTA PLC	86	86	60	60	8,455	8,455	素材
STANDARD LIFE PLC	424.63	454.63	158	158	22,209	22,209	金融
EXPERIAN PLC	209.54	230.54	345	345	48,572	48,572	資本財・サービス
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	99,273.49 107銘柄	89,754.12 106銘柄	39,793	5,589.335	< 7.1% >	
(イスラエル)	百株	百株	千円	千円			
AZRIELI GROUP LTD	—	10	164	164	4,829	4,829	不動産
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	564	564	398	398	11,681	11,681	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD	140	140	201	201	5,910	5,910	素材
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	189	—	—	—	—	—	ヘルスケア
BANK HAPOALIM BM	265	265	613	613	17,987	17,987	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	376	376	583	583	17,120	17,120	金融
NICE LTD	17	17	430	430	12,615	12,615	情報技術
イスラエル・シケル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,551 6銘柄	1,372 6銘柄	2,392	70,144	< 0.1% >	
(スイス)	百株	百株	千円	千円			
DUFREY AG-REG	9	10.5	130	130	14,501	14,501	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	802	860	1,357	1,357	150,880	150,880	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	—	2	101	101	11,288	11,288	素材
ADECCO GROUP AG-REG	37	40	250	250	27,777	27,777	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSEIN	153.5	165	3,735	3,735	415,062	415,062	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	8	8	51	51	5,671	5,671	金融
SIKA AG-BR	0.54	0.54	263	263	29,327	29,327	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.02	117	117	13,015	13,015	生活必需品
ABB LTD-REG	483	439	907	907	100,871	100,871	資本財・サービス
ARYZTA AG	21	21	92	92	10,259	10,259	生活必需品
TRANSOCEAN LTD	84.5	—	—	—	—	—	エネルギー
SWISS RE AG	78	78	726	726	80,685	80,685	金融
NESTLE SA-REG	699.5	727	4,965	4,965	551,706	551,706	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3.5	4.2	209	209	23,251	23,251	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	10	10	179	179	19,966	19,966	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	341.2	435.2	585	585	65,085	65,085	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	52	52	231	231	25,716	25,716	金融
SULZER AG-REG	6.5	—	—	—	—	—	資本財・サービス
SGS SA-REG	1.3	1.3	262	262	29,220	29,220	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	—	5	88	88	9,838	9,838	資本財・サービス
GALENICA AG-REG	—	0.9	95	95	10,619	10,619	ヘルスケア

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
SWATCH GROUP AG/THE-BR	百株	百株	7	7.5	221	24,649	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	33.32	35.12	93	103	103,407	103,407	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	12	12	149	149	16,573	16,573	金融
NOVARTIS AG-REG	496.5	522	3,656	406,285	406,285	ヘルスケア	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	—	0.5	60	6,744	6,744	生活必需品	
CIE FINANCIERE RICHMONT-REG	114.5	123.5	805	89,467	89,467	一般消費財・サービス	
SWISSCOM AG-REG	5.5	5.9	255	28,418	28,418	電気通信サービス	
GEBERIT AG-REG	8	9	360	40,069	40,069	資本財・サービス	
GIVAUDAN-REG	2.1	2.2	400	44,488	44,488	素材	
ACTELION LTD-REG	23	22.5	470	52,249	52,249	ヘルスケア	
SYNGENTA AG-REG	20.12	21.62	829	92,220	92,220	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	13	13	160	17,795	17,795	ヘルスケア	
LONZA GROUP AG-REG	13	13	234	26,100	26,100	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	11	11	63	7,070	7,070	一般消費財・サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	95.4	108.4	569	63,292	63,292	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	8	8	224	24,897	24,897	金融	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	12.5	12.5	165	18,374	18,374	資本財・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	14	16	133	14,870	14,870	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	—	0.23	116	12,994	12,994	生活必需品	
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,679.5 35銘柄	3,803.63 38銘柄	24,162	2,684,721	< 3.4% >	
(デンマーク)	百株	百株	千円	千円			
NOVO NORDISK A/S-B	428	450	10,354	166,603	166,603	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S	152.5	163.5	3,368	54,192	54,192	金融	
ISS A/S	—	39	947	15,242	15,242	資本財・サービス	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.95	0.95	842	13,550	13,550	資本財・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52	52	2,445	39,340	39,340	資本財・サービス	
TDC A/S	193	193	690	11,117	11,117	電気通信サービス	
CARLSBERG AS-B	24.5	24.5	1,460	23,494	23,494	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	55	55	1,310	21,088	21,088	素材	
COLOPLAST-B	25	28	1,236	19,890	19,890	ヘルスケア	
DSV A/S	42	46	1,444	23,247	23,247	資本財・サービス	
WILLIAM DEMANT HOLDING	6.75	33.75	391	6,299	6,299	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1.6	1.6	1,496	24,083	24,083	資本財・サービス	
PANDORA A/S	25	26.5	2,232	35,922	35,922	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	—	23.5	933	15,026	15,026	素材	
GENMAB A/S	—	13	1,608	25,874	25,874	ヘルスケア	
デンマーク・クローネ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,006.3 12銘柄	1,150.3 15銘柄	30,762	494,974	< 0.6% >	
(ノルウェー)	百株	百株	千円	千円			
NORSK HYDRO ASA	299	334	1,352	17,828	17,828	素材	
DNB ASA	211.5	225.5	2,753	36,289	36,289	金融	
ORKLA ASA	190.5	190.5	1,458	19,220	19,220	生活必需品	
TELENOR ASA	158	178	2,255	29,724	29,724	電気通信サービス	
STATOIL ASA	241.73	261.73	3,656	48,190	48,190	エネルギー	
SCHIBSTED ASA-CL A	—	15	275	3,635	3,635	一般消費財・サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	37.6	41.6	1,321	17,419	17,419	素材	
MARINE HARVEST	—	87	1,345	17,738	17,738	生活必需品	
GIJENSIDIGE FORSKRING ASA	39.5	48.5	671	8,853	8,853	金融	
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	18	315	4,163	4,163	一般消費財・サービス	
ノルウェー・クローネ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,177.83 7銘柄	1,399.83 10銘柄	15,406	203,063	< 0.3% >	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
(スウェーデン)	百株	百株	千ユーロ	千円			
ICA GRUPPEN AB	13	19	518	6,356	生活必需品		
ERICSSON LM-B SHS	655.3	722.3	3,406	41,727	情報技術		
VOLVO AB-B SHS	324	345	3,372	41,311	資本財・サービス		
MILICOM INTL CELLULAR-SDR	15	15	587	7,195	電気通信サービス		
SKF AB-B SHARES	86.5	86.5	1,403	17,197	資本財・サービス		
ELECTROLUX AB-SER B	54.5	54.5	1,167	14,300	一般消費財・サービス		
NORDEA BANK AB	654.5	706.5	6,743	82,608	金融		
SWEDISH MATCH AB	45.5	45.5	1,322	16,197	生活必需品		
TELE2 AB-B SHS	89.5	89.5	627	7,685	電気通信サービス		
GETINGE AB-B SHS	47	47	677	8,296	ヘルスケア		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	320.5	341.5	3,114	38,152	金融		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	321	352	4,403	53,943	金融		
SWEDBANK AB - A SHARES	199	213	4,498	55,107	金融		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	208	217	5,815	71,241	一般消費財・サービス		
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	124	141	3,443	42,179	生活必需品		
SKANSKA AB-B SHS	82.5	82.5	1,723	21,111	資本財・サービス		
SANDVIK AB	223.5	244.5	2,650	32,467	資本財・サービス		
INVESTOR AB-B SHS	101	108	3,333	40,841	金融		
ATLAS COPCO AB-A SHS	144	157	4,322	52,947	資本財・サービス		
SECURITAS AB-B SHS	92	92	1,213	14,865	資本財・サービス		
TELIA CO AB	558	600	2,080	25,489	電気通信サービス		
ALFA LAVAL AB	70	70	967	11,850	資本財・サービス		
ATLAS COPCO AB-B SHS	83	91	2,224	27,255	資本財・サービス		
ASSA ABLOY AB-B	211	233	3,961	48,522	資本財・サービス		
LUNDIN PETROLEUM AB	64	64	1,054	12,920	エネルギー		
BOLIDEN AB	60	60	1,426	17,478	素材		
HUSQVARNA AB-B SHS	125.5	125.5	852	10,446	一般消費財・サービス		
KINNEVIK AB - B	53	53	1,187	14,549	金融		
HEXAGON AB-B SHS	55.5	62	1,957	23,985	情報技術		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	-	35	559	6,851	金融		
スウェーデン・クロネ 通貨計	株数、金額 29銘柄数<比率>	5,080.3 29銘柄	5,472.8 30銘柄	70,619 865,083	141,808 < 1.1%>		
ユーロ (アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円			
BANK OF IRELAND	6,618	6,618	132	15,843	金融		
KERRY GROUP PLC-A	34	38.5	256	30,692	生活必需品		
CRH PLC	175	194	604	72,347	素材		
PADDY POWER BETFAIR PLC	-	19	191	22,924	一般消費財・サービス		
国小計	株数、金額 3銘柄数<比率>	6,827 3銘柄	6,869.5 4銘柄	1,184 141,808	< 0.2%>		
ユーロ (オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
QIAGEN N.V.	48.5	54.5	140	16,863	ヘルスケア		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	204.76	218.76	602	72,075	資本財・サービス		
NN GROUP NV	48	76	230	27,600	金融		
UNILEVER NV-CVA	351.5	383.5	1,419	169,963	生活必需品		
HEINEKEN NV	51	53	376	45,119	生活必需品		
RELX NV	214.19	234.19	358	42,889	資本財・サービス		
AEGON NV	407.44	407.44	193	23,209	金融		
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	192.93	298.83	565	67,676	生活必需品		
AKZO NOBEL	55	58	339	40,621	素材		
KONINKLIJKE DSM NV	38	44	251	30,047	素材		
WOLTERS KLUWER	69	69	233	27,949	資本財・サービス		
BOSKALING WESTMINSTER	21	21	61	7,337	資本財・サービス		
ING GROEP NV	847.5	918.5	1,159	138,804	金融		

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

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

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
ユーロ (ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
BAYER AG-REG	180.5	195.5	1,735	207,733	ヘルスケア		
EVONIK INDUSTRIES AG	30	38	98	11,799	素材		
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	299.5	321.5	471	56,416	金融		
COMMERZBANK AG	229.85	246.85	158	18,949	金融		
VOLKSWAGEN AG	8	8	103	12,444	一般消費財・サービス		
VOLKSWAGEN AG-PREF	35.5	43.5	533	63,837	一般消費財・サービス		
MAN SE	8.5	8.5	79	9,500	資本財・サービス		
SIEMENS AG-REG	173	179	1,899	227,333	資本財・サービス		
E.ON SE	445	465	289	34,620	公益事業		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	72.5	77.5	629	75,327	一般消費財・サービス		
GEA GROUP AG	42	42	147	17,688	資本財・サービス		
OSRAM LICHT AG	19.1	21.6	102	12,329	資本財・サービス		
CONTINENTAL AG	24.5	25.5	428	51,264	一般消費財・サービス		
BASF SE	201	216.5	1,703	203,899	素材		
LINDE AG	40.5	44	660	79,054	素材		
K+S AG-REG	44	44	83	9,964	素材		
ALLIANZ SE-REG	98.5	106.8	1,606	192,270	金融		
THYSSENKRUPP AG	78	85	178	21,417	素材		
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	39	42	454	54,421	生活必需品		
RWE AG	108	118	141	16,977	公益事業		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50.5	50.5	62	7,510	資本財・サービス		
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	9	9	49	5,865	資本財・サービス		
BRENNTAG AG	34	36.5	178	21,314	資本財・サービス		
FRESENIUS SE & CO KGAA	84	97	662	79,325	ヘルスケア		
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	27	27	97	11,722	情報技術		
HOCHTIEF AG	-	5	66	7,924	資本財・サービス		
SAP SE	214.92	231.42	1,844	220,749	情報技術		
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	36.5	38.7	669	80,094	金融		
SCHAEFFLER AG	-	38	46	5,567	一般消費財・サービス		
ZALANDO SE	-	19	68	8,152	一般消費財・サービス		
HEIDELBERGCEMENT AG	31	33	277	33,208	素材		
COVESTRO AG	-	16	94	11,251	素材		
INNOGY SE	-	34	114	13,658	公益事業		
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	34	37	178	21,334	一般消費財・サービス		
BEIERSDORF AG	21.5	23	177	21,256	生活必需品		
FUCHS PETROLUB SE - PREF	-	15	55	6,701	素材		
MERCK KGAA	29	31	295	35,359	ヘルスケア		
ADIDAS AG	45.7	44.2	616	73,752	一般消費財・サービス		
HENKEL AG & CO KGAA	22	24	226	27,093	生活必需品		
METRO AG	37	41	114	13,675	生活必需品		
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	694	754	1,114	133,395	電気通信サービス		
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	48.5	50.5	373	44,731	ヘルスケア		
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	210.5	225	1,429	171,129	一般消費財・サービス		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	247.5	270	432	51,758	情報技術		
HANNOVER RUECK SE	14	14	140	16,774	金融		
DEUTSCHE POST AG-REG	212	231	676	80,975	資本財・サービス		
DEUTSCHE BOERSE AG	41.5	-	-	-	金融		
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	-	46	347	41,643	金融		
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	47.5	50.5	160	19,222	一般消費財・サービス		
LANXESS AG	19.5	22	127	15,207	素材		
AXEL SPRINGER SE	-	10	40	4,895	一般消費財・サービス		
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	76.5	82	240	28,739	不動産		
SYMRISE AG	28	30	170	20,443	素材		
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	5.5	-	-	-	一般消費財・サービス		

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		当 期		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		業 種 等		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	百株	百株	千ユーロ	千円			電気通信サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	128	165	59	7,131			一般消費財・サービス
HUGO BOSS AG -ORD	—	12	82	9,835			一般消費財・サービス
VONOVIA SE	14	16.5	89	10,730			不動産
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,744.07 49銘柄	5,266.57 56銘柄	23,221	2,779,621	< 3.5% >	
ユーロ (ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円			
JERONIMO MARTINS	60	60	89	10,704			生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	495	495	134	16,057			公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	103.5	103.5	126	15,133			エネルギー
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	658.5 3銘柄	658.5 3銘柄	350	41,895	< 0.1% >	
ユーロ (スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円			
TELEFONICA SA	969.27	1,046.27	826	98,925			電気通信サービス
ENDESA SA	68.5	76.5	149	17,888			公益事業
BANCO POPULAR ESPANOL	404.73	574.73	59	7,109			金融
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,371.12	1,534.12	886	106,140			金融
IBERDROLA SA	1,162.34	1,271.34	728	87,214			公益事業
BANCO DE SABADELL SA	1,077.16	1,319.09	151	18,189			金融
BANKINTER SA	131	151	104	12,561			金融
REPSOL SA	223	257	310	37,161			エネルギー
GRIFOLS SA	33.5	67	123	14,796			ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	3,121.5	3,438.5	1,465	175,418			金融
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	101	149	185	22,213			資本財・サービス
AMADEUS IT GROUP SA	96	100	428	51,321			情報技術
GAS NATURAL SDG SA	74.5	84.5	137	16,466			公益事業
MAPFRE SA	214.5	214.5	60	7,245			金融
CAIXABANK S.A	538	748	203	24,335			金融
CAIXABANK S.A-RTS	—	748	2	349			その他
ZARDOYA OTIS SA	45.5	45.5	33	3,986			資本財・サービス
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	180	180	94	11,294			資本財・サービス
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	37.76	44.76	122	14,704			資本財・サービス
AENA SA	14.5	16	203	24,380			資本財・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	239	253	821	98,287			一般消費財・サービス
ENAGAS SA	47	54	126	15,173			公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	25	100	169	20,343			公益事業
FERROVIAL SA	98	117	195	23,402			資本財・サービス
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	187	157	70	8,434			生活必需品
BANKIA SA	1,084.22	1,084.22	89	10,668			金融
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	11,544.1 25銘柄	14,011.03 26銘柄	7,752	928,014	< 1.2% >	
ユーロ (イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円			
UNIPOLSAI SPA	217.5	217.5	38	4,605			金融
BANCO POPOLARE SC	83	—	—	—			金融
PRYSMIAN SPA	57	48	108	12,973			資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	253.43	278.43	324	38,793			金融
SAIPEM SPA	61	1,343	51	6,219			エネルギー
MEDIOBANCA SPA	146.15	146.15	91	10,977			金融
UNICREDIT SPA	1,037.69	1,235.69	239	28,694			金融
TELECOM ITALIA SPA	2,457.82	2,582.82	181	21,734			電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP	1,349.5	1,349.5	78	9,385			電気通信サービス
INTESA SANPAOLO-RSP	—	210	39	4,776			金融
INTESA SANPAOLO	2,745.97	2,985.97	608	72,842			金融
ATLANTIA SPA	89.07	99.07	201	24,156			資本財・サービス

銘柄	期首		当 期		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		業 種 等		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
POSTE ITALIANE SPA	百株	百株	千ユーロ	千円			金融
ENI SPA	—	118	67	8,135			エネルギー
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	544	598	757	90,621			資本財・サービス
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	112.25	95.25	116	13,886			金融
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	508.15 21銘柄	— 19銘柄	—	—	< 0.6% >	
ユーロ (フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円			
UPM-KYMMENE OYJ	113	124	266	31,882			素材
NOKIA OYJ	776.5	1,358.5	546	65,370			情報技術
WARTSILA OYJ ABP	32	32	127	15,244			資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	131	131	118	14,222			素材
METSO OYJ	30	30	78	9,437			資本財・サービス
ELISA OYJ	35.5	35.5	106	12,701			電気通信サービス
SAMPO OYJ-A SHS	96.5	103	427	51,116			公益事業
FORTUM OYJ	94.5	104.5	143	17,136			公益事業
KONE OYJ-B	66.5	78.5	323	38,685			資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ	30	30	100	12,054			一般消費財・サービス
NESTE OYJ	34.5	29.5	112	13,467			エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	20.5	20.5	82	9,884			ヘルスケア
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,460.5 12銘柄	2,077 12銘柄	2,432	291,203	< 0.4% >	
ユーロ (オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円			
OMV AG	35.5	35.5	105	12,609			エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	55.5	66.5	171	20,528			金融
VOESTALPINE AG	28.5	28.5	101	12,190			素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	24	24	40	4,895			金融
ANDRITZ AG	16	16	77	9,230			資本財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	159.5 5銘柄	170.5 5銘柄	496	59,455	< 0.1% >	
ユーロ (その他)	百株	百株	千ユーロ	千円			
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	—	52	162	19,460			生活必需品
STMICROELECTRONICS NV	137	153	142	17,052			情報技術
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	137 1銘柄	205 2銘柄	305	36,512	< 0.0% >	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	49,132.57 222銘柄	54,940 232銘柄	76,154	9,115,717	< 11.5% >	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	283,613.45 1,201銘柄	291,354.98 1,238銘柄	—	75,856,759	< 96.0% >	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首		当 期		期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.847	3.197	526	59,215		
SIMON PROPERTY GROUP INC	6.587	7.187	1,310	147,291		
BOSTON PROPERTIES INC	3.3	3.6	450	50,694		
GENERAL GROWTH PROPERTIES	12.1	13.6	348	39,231		
VORNADO REALTY TRUST	3.627	3.827	379	42,635		
EQUITY RESIDENTIAL	7.9	8.5	514	57,802		
EQUINIX INC	1.158	1.608	552	62,075		
AMERICAN TOWER CORP	9.1	9.75	1,033	116,240		
HOST HOTELS & RESORTS INC	16.093	17.293	299	33,632		
KIMCO REALTY CORP	8.7	10	260	29,274		
PLUM CREEK TIMBER CO	3.7	-	-	-		
VENTAS INC	7	7.9	482	54,237		
WEYERHAEUSER CO	11.094	17.614	548	61,701		
AGNC INVESTMENT CORP	7.8	7.8	148	16,669		
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	-	6.9	172	19,446		
CROWN CASTLE INTL CORP	7.2	7.75	660	74,257		
IRON MOUNTAIN INC	3.91	5.61	189	21,272		
VEREIT INC	20.4	22.3	189	21,359		
PROLOGIS INC	11.062	12.262	630	70,909		
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	-	1.7	189	21,351		
CAMDEN PROPERTY TRUST	1.8	2	158	17,820		
DUKE REALTY CORP	7.3	8	206	23,212		
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.4	1.48	319	35,916		
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1.5	1.6	226	25,505		
WELLTOWER INC	7.4	8.3	532	59,894		
HCP INC	9.7	10.7	316	35,605		
LIBERTY PROPERTY TRUST	3.3	3.3	131	14,739		
MID-AMERICA APARTMENT COMM	-	1.7	159	17,928		
MACERICH CO/THE	3	3	207	23,321		
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	19.8	23.2	240	27,046		
REALTY INCOME CORP	4.8	6	340	38,272		
PUBLIC STORAGE	3.1	3.4	712	80,118		
REGENCY CENTERS CORP	2.1	2.3	153	17,298		
SL GREEN REALTY CORP	2.1	2.25	238	26,819		
UDR INC	5.7	6.3	215	24,214		
DIGITAL REALTY TRUST INC	2.8	3.7	345	38,891		
EXTRA SPACE STORAGE INC	2.3	2.75	194	21,903		
アメリカ・ドル 通 貨 計	221,678 34銘柄	258,378 36銘柄	13,590	1,527,811 <1.9%>		
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円		
SMART REAL ESTATE INVESTMENT	-	1.5	47	3,952		
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	-	3	65	5,470		
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	-	3.3	88	7,442		
カナダ・ドル 通 貨 計	- -	7.8 3銘柄	201	16,864 <0.0%>		
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円		
SCENTRE GROUP	116.322	121.922	513	43,188		
DEXUS PROPERTY GROUP	23.95	23.95	216	18,176		
GPT GROUP	40.06	40.06	189	15,943		
MIRVAC GROUP	93.4	93.4	190	16,031		
STOCKLAND	51.5	57	244	20,574		
WESTFIELD CORP	43.096	45.496	414	34,911		
GOODMAN GROUP	38.2	41.7	273	23,051		

銘柄	期首		当 期		期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千オーストラリア・ドル	千円		
VICINITY CENTRES	74.873	74.873	213	17,954		
オーストラリア・ドル 通 貨 計	481,401 8銘柄	498,401 8銘柄	2,256	189,832 <0.2%>		
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円		
LINK REIT	49.5	52	2,750	39,886		
香 港 ド ル 通 貨 計	49.5 1銘柄	52 1銘柄	2,750	39,886 <0.1%>		
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	48	48	110	8,756		
CAPITALAND MALL TRUST	63.2	63.2	120	9,532		
SUNTEC REIT	-	53	88	7,010		
シンガポール・ドル 通 貨 計	111.2 2銘柄	164.2 3銘柄	320	25,299 <0.0%>		
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円		
LAND SECURITIES GROUP PLC	17.1	18.2	177	24,924		
SEGRO PLC	16.75	19.95	83	11,729		
HAMMERSON PLC	17.4	17.4	95	13,442		
BRITISH LAND CO PLC	20.9	22.1	132	18,624		
INTU PROPERTIES PLC	21.1	21.1	57	8,049		
イギリス・ポンド 通 貨 計	93.25 5銘柄	98.75 5銘柄	546	76,770 <0.1%>		
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円		
UNIBAIL-RODAMCO SE	2.15	2.36	497	59,577		
ICADE	0.75	0.75	48	5,815		
GECINA SA	0.75	0.95	116	13,992		
KLEPIERRE	4.15	5.2	183	22,003		
FONCIERE DES REGIONS	0.75	0.75	55	6,647		
国 小 計	8.55 5銘柄	10.01 5銘柄	902	108,036 <0.1%>		
合 計	965,579 55銘柄	1,089,539 61銘柄	-	1,984,502 <2.5%>		

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国 S & P 500 (アメリカ)	百万円 1,114	百万円 -

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

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

項目	当期		比率
	評価額	千円	
株式	75,856,759		95.3%
投資信託証券	1,984,502		2.5%
コール・ローン等、その他	1,789,729		2.2%
投資信託財産総額	79,630,991		100.0%

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=112.42円、1カナダ・ドル=83.68円、1オーストラリア・ドル=84.14円、1香港ドル=14.50円、1シンガポール・ドル=78.97円、1ニュージーランド・ドル=80.25円、1イギリス・ポンド=140.46円、1イスラエル・シケル=29.32円、1スイス・フラン=111.11円、1デンマーク・クローネ=16.09円、1ノルウェー・クローネ=13.18円、1スウェーデン・クローネ=12.25円、1ユーロ=119.70円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(78,796,718千円)の投資信託財産総額(79,630,991千円)に対する比率は、99.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年11月30日現在

項目	当期	
	評価額	千円
(A) 資産	79,630,991,270円	
コール・ローン等	775,049,476	
株式(評価額)	75,856,759,279	
投資信託証券(評価額)	1,984,502,691	
未収入金	339,367,491	
未収配当金	162,157,303	
差入委託証拠金	513,155,030	
(B) 負債	624,937,800	
未払解約金	624,937,800	
(C) 純資産総額(A-B)	79,006,053,470	
元本	40,539,431,105	
次期繰越増益金	38,466,622,365	
(D) 受益権総口数	40,539,431,105口	
1万口当り基準価額(C/D)	19,489円	

*期首における元本額は38,848,551,378円、当期中における追加設定元本額は5,066,388,246円、同解約元本額は3,375,508,519円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国株式インデックスV A 725,982,741円、ダイワ国内重視/バランスファンド3 0 V A (一般投資家私募) 32,240,774円、ダイワ国内重視/バランスファンド5 0 V A (一般投資家私募) 463,206,991円、ダイワ国際分散/バランスファンド3 0 V A (一般投資家私募) 50,975,833円、ダイワ国際分散/バランスファンド5 0 V A (一般投資家私募) 1,543,587,080円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージンググラス (為替ヘッジなし) 88,958,951円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジなし) 147,732,667円、D-1's 外国株式インデックス1,957,148円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 182,021円、iFree 外国株式インデックス184,046,036円、iFree 8資産バランス31,235,406円、DCダイワ外国株式インデックス22,444,872,014円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 550,340,778円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 735,584,538円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 553,544,620円、大和DC海外株式インデックスファンド1,470,526,931円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 7,625,022円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 15,729,186円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 3,621,406円、ダイワ世界分散/バランスファンド1.5 V A 100,000円、ダイワ世界分散/バランスファンド2 0 V A 197,107円、ダイワ世界分散/バランスファンド2.5 V A 19,292,523円、ダイワ世界分散/バランスファンド3 0 V A 163,931,206円、ダイワ世界/バランスファンド4 0 V A 1,955,664,069円、ダイワ世界/バランスファンド6 0 V A 519,301,921円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 5,011,815,577円、ダイワ・バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家専用) 231,056,464円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式399,881,832円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド17,952,452円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス3,006,649,223円、ダイワライフスタイル2 5 23,902,625円、ダイワライフスタイル5 0 78,118,426円、ダイワライフスタイル7 5 59,617,537円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は19,489円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月1日 至2016年11月30日

項目	当期	
	金額	千円
(A) 配当等収益	1,735,622,631円	
受取配当金	1,733,407,040	
受取利息	620,632	
その他収益金	1,828,778	
支払利息	△ 233,819	
(B) 有価証券売買損益	△ 5,593,027,175	
売買益	6,250,559,303	
売買損	△ 11,843,586,478	
(C) 先物取引等損益	84,540,402	
取引益	133,979,683	
取引損	△ 49,439,281	
(D) その他費用	△ 45,670,039	
(E) 当期増益金(A+B+C+D)	△ 3,818,534,181	
(F) 前期繰越増益金	41,029,358,109	
(G) 解約差増益金	△ 2,818,377,481	
(H) 追加信託差増益金	4,074,175,918	
(I) 合計(E+F+G+H)	38,466,622,365	
次期繰越増益金(I)	38,466,622,365	

(注1) 解約差増益金とは、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) 追加信託差増益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

《お知らせ》

●投資信託証券への投資制限の変更

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

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第17期 (決算日 2016年11月30日)

(計算期間 2015年12月1日～2016年11月30日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

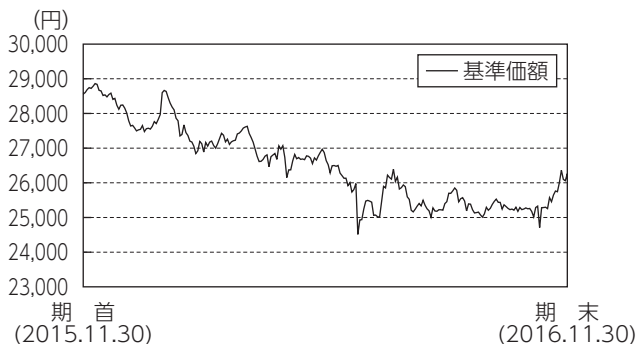
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



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

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し円ベースで表示した債券インデックスです。
- (注3) シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) の原データに基づき、当ファンド設定日を10.00として大和投資信託が計算したものです。
- (注4) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。
- (注6) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：28,558円 期末：26,265円 騰落率：△8.0%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外債券市況

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

○為替相場

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	7 (7)
合計	7

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況
公 社 債

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

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

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国 (外貨建) 公社債 (通貨別)

作 成 期 区 分	額 面 金 額	当 期			未 期				
		外 貨 建 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 5 年 以 上	間 別 2 年 以 上	組 入 比 率	2 年 未 満
アメリカ	千アメリカ・ドル 590,540	千アメリカ・ドル 599,940	千円 67,445,295	43.5%	%	%	%	%	%
カナダ	千カナダ・ドル 34,684	千カナダ・ドル 38,441	3,216,825	2.1	—	1.0	0.6	0.5	—
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 34,514	千オーストラリア・ドル 37,263	3,135,370	2.0	—	1.3	0.6	0.2	—
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,037	千シンガポール・ドル 7,286	575,419	0.4	—	0.2	0.1	0.1	—
イギリス	千イギリス・ポンド 62,812	千イギリス・ポンド 78,823	11,071,541	7.1	—	5.1	1.6	0.4	—
スイス	千スイス・フラン 2,792	千スイス・フラン 3,304	367,180	0.2	—	0.1	0.1	0.0	—
デンマーク	千デンマーク・クローネ 51,791	千デンマーク・クローネ 65,733	1,057,649	0.7	—	0.4	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 28,227	千ノルウェー・クローネ 30,237	398,524	0.3	—	0.1	0.1	—	—
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 47,400	千スウェーデン・クローネ 55,521	680,141	0.4	—	0.3	0.2	—	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 219,416	千メキシコ・ペソ 225,977	1,231,577	0.8	—	0.4	0.3	0.1	—
マレーシア	千マレーシア・リンギット 27,216	千マレーシア・リンギット 26,495	667,167	0.4	—	0.2	0.1	0.1	—
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 104,423	千南アフリカ・ランド 94,587	766,157	0.5	—	0.4	0.1	—	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 31,114	千ポーランド・ズロチ 31,602	852,954	0.6	—	0.2	0.3	0.1	—
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 8,336	千ユーロ 9,775	1,170,103	0.8	—	0.4	0.3	0.1	—
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 25,028	千ユーロ 30,098	3,602,804	2.3	—	1.4	0.5	0.3	—
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 25,843	千ユーロ 32,303	3,866,730	2.5	—	1.8	0.5	0.2	—
ユーロ (フランス)	千ユーロ 104,489	千ユーロ 125,253	14,992,864	9.7	—	6.0	2.8	0.9	—
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 78,396	千ユーロ 94,031	11,255,580	7.3	—	4.2	2.2	0.9	—
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 59,673	千ユーロ 69,975	8,376,016	5.4	—	3.3	1.5	0.6	—
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 105,258	千ユーロ 121,214	14,509,366	9.4	—	5.6	2.9	0.9	—
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 6,718	千ユーロ 7,626	912,887	0.6	—	0.4	0.2	0.0	—

作成期 区分	当 期				未 期			
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
	外 貨 建 金 額	千 円	千 円			%	5 年 以 上	2 年 以 上
ユーロ (オーストリア)	15,749	19,264	2,305,937	1.5	—	0.9	0.4	0.1
ユーロ (小計)	429,990	509,542	60,992,290	39.4	—	24.1	11.3	4.0
合 計	—	—	152,458,096	98.4	—	51.4	33.2	13.8

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	期 末				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,686	1,740	195,662	2017/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,839	3,957	444,847	2018/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	2,960	3,084	346,709	2018/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.0000	3,173	3,333	374,808	2018/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,488	2,615	294,024	2018/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,161	3,270	367,630	2019/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,096	3,238	364,038	2019/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	2,621	2,784	313,021	2019/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,020	4,256	478,461	2019/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,280	4,573	514,198	2020/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	3,073	3,278	368,568	2020/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,854	2,960	332,827	2020/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,372	2,394	269,190	2017/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,509	4,679	526,027	2020/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	883	895	100,634	2017/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	924	941	105,884	2017/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	255	259	29,224	2018/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,076	4,397	494,377	2021/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,234	1,261	141,836	2018/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,300	1,332	149,827	2018/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	260	266	29,906	2018/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,702	303,763	2021/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,322	1,349	151,665	2018/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,065	1,088	122,313	2018/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,341	1,368	153,833	2018/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,570	288,954	2021/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,444	3,469	390,078	2018/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,835	2,849	320,377	2018/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,320	1,336	150,237	2018/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,169	243,911	2021/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,165	2,176	244,691	2018/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,861	1,870	210,316	2018/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,426	1,429	160,673	2019/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,244	364,790	2022/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,843	1,851	208,176	2019/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	300	302	33,974	2019/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	559	559	62,913	2019/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,436	273,955	2022/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,385	2,378	267,440	2022/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,368	1,359	152,810	2019/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,784	1,765	198,471	2019/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,497	280,723	2022/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,872	1,856	208,756	2019/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,215	2,195	246,831	2019/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,648	2,646	297,488	2017/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	884	882	99,165	2019/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,168	3,099	348,464	2022/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	2,336	2,330	262,016	2017/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,353	1,338	150,522	2019/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	1,913	1,910	214,739	2017/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,894	1,879	211,258	2019/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,153	2,151	241,916	2018/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,366	1,364	153,415	2020/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,850	3,840	431,765	2023/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	3,447	3,439	386,616	2018/02/28	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価		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	1.2500	1,968	1,956	219,979	2020/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	0.7500	2,315	2,308	259,518	2018/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.1250	1,160	1,147	128,994	2020/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.7500	4,685	4,591	516,153	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	0.6250	4,218	4,196	471,778	2018/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.1250	1,451	1,433	161,196	2020/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.0000	3,407	3,407	383,041	2018/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.3750	2,461	2,449	275,390	2020/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.3750	1,693	1,702	191,389	2018/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.8750	2,131	2,156	242,458	2020/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.0000	2,827	2,870	322,724	2020/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.3750	1,697	1,706	191,848	2018/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.5000	3,768	3,863	434,285	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.1250	1,993	2,031	228,375	2020/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.0000	1,885	1,912	215,022	2020/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.2500	3,611	3,622	407,215	2018/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.7500	2,345	2,356	264,900	2020/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.7500	5,021	5,228	587,784	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.2500	2,638	2,645	297,453	2018/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.0000	2,501	2,534	284,873	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.5000	2,026	2,042	229,575	2018/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.3750	2,006	2,062	231,855	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.7500	5,229	5,443	611,998	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.5000	2,185	2,201	247,516	2019/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.1250	1,647	1,676	188,453	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.5000	2,373	2,390	268,773	2019/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.0000	1,734	1,754	197,281	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.6250	2,383	2,407	270,637	2019/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.2500	2,821	2,882	324,072	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.5000	5,412	5,536	622,434	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.6250	2,975	3,004	337,793	2019/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.2500	2,407	2,459	276,512	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.5000	2,241	2,256	253,643	2019/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.0000	2,732	2,761	310,463	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	1.6250	2,885	2,912	327,422	2019/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.1250	3,485	3,540	397,993	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	8.8750	904	1,058	119,023	2019/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	8.1250	724	855	96,178	2019/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	8.7500	642	808	90,893	2020/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	8.0000	2,106	2,721	305,896	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	6.2500	654	825	92,827	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	6.0000	855	1,119	125,892	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	6.5000	630	865	97,256	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	6.1250	709	965	108,499	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	5.5000	700	919	103,340	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	5.2500	738	953	107,142	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	5.2500	473	613	68,923	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	6.2500	964	1,382	155,413	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	5.3750	1,241	1,676	188,451	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	4.5000	1,926	2,477	278,465	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	5.0000	547	747	84,029	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	4.3750	548	693	77,969	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	4.5000	1,019	1,310	147,364	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	3.5000	849	947	106,495	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	4.2500	1,121	1,388	156,041	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	4.5000	760	971	109,261	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	4.3750	1,210	1,522	171,150	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	4.6250	1,710	2,227	250,374	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	4.3750	1,478	1,860	209,174	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	3.8750	1,591	1,862	209,418	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	4.2500	1,469	1,815	204,120	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	4.7500	1,754	2,328	261,715	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	4.3750	1,365	1,720	193,411	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	3.7500	1,367	1,569	176,405	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	3.1250	1,450	1,500	168,675	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	3.1250	1,623	1,680	188,871	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	3.0000	1,853	1,875	210,803	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.7500	1,731	1,672	188,015	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国	債 証 券	2.7500	3,030	2,922	328,574	2042/11/15

区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 償 還 金 額			償 還 年 月 日
						評 価 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,026	2,097	235,805	2043/02/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,998	3,943	443,306	2043/05/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,314	3,756	422,300	2043/08/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	3,581	4,149	466,452	2043/11/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,617	4,098	460,785	2044/02/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,357	3,635	408,732	2044/05/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,326	3,356	377,296	2019/07/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,891	325,094	2021/07/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,662	5,734	644,624	2024/08/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,729	3,856	433,589	2044/08/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,989	3,015	339,000	2019/08/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,312	147,497	2021/08/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,404	3,445	387,308	2019/09/30			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,675	413,219	2021/09/30			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,190	3,204	360,244	2019/10/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,179	244,988	2021/10/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,932	666,883	2024/11/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,696	3,731	419,464	2044/11/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,593	1,593	179,119	2017/11/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,890	324,937	2021/11/30			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,325	4,342	488,132	2019/11/30			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,517	1,518	170,759	2017/12/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,210	360,876	2021/12/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,204	2,220	249,572	2019/12/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,547	1,546	173,838	2018/01/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,963	3,942	443,257	2020/01/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,427	2,382	267,853	2022/01/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,635	633,522	2025/02/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,763	3,424	384,992	2045/02/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	1,961	1,962	220,636	2018/02/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,788	2,781	312,690	2020/02/29			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,809	1,796	201,921	2022/02/28			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,081	2,082	234,100	2018/03/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,792	2,784	312,991	2020/03/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,083	2,076	233,428	2018/04/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,867	322,363	2022/03/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,180	2,180	245,102	2018/05/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,723	643,464	2025/05/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,035	4,065	457,016	2045/05/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,607	2,597	291,956	2020/04/30			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,588	291,001	2022/04/30			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,816	316,631	2022/05/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,013	3,010	338,453	2020/05/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,196	2,199	247,286	2018/06/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,001	3,009	338,320	2020/06/30			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,847	320,083	2022/06/30			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,189	2,183	245,518	2018/07/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,135	3,140	353,067	2020/07/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,182	245,401	2022/07/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,143	6,005	675,105	2025/08/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,573	3,510	394,615	2045/08/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	14	13	1,572	2018/08/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,431	273,363	2022/08/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,868	2,844	319,825	2020/08/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,179	2,176	244,627	2018/09/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,439	274,231	2022/09/30			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,876	2,850	320,413	2020/09/30			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,057	2,049	230,387	2018/10/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,820	654,326	2025/11/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,116	3,085	346,906	2020/10/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	3,734	419,830	2045/11/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,540	285,568	2022/10/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,138	2,144	241,075	2018/11/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,277	2,277	256,028	2017/11/30			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,092	347,617	2020/11/30			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,687	2,684	301,833	2022/11/30			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,151	2,156	242,465	2018/12/15			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	3,051	343,082	2020/12/31			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,276	2,278	256,177	2017/12/31			

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,492	2,505	281,638	2022/12/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,146	2,145	241,185	2019/01/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,126	3,085	346,891	2021/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,366	5,062	569,071	2026/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,329	2,324	261,281	2018/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,065	2,047	230,160	2019/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,518	283,093	2023/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,428	3,110	349,728	2046/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,100	2,092	235,203	2019/03/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,309	3,230	363,133	2021/02/28
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,262	2,188	246,029	2023/02/28
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,942	330,785	2021/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	700	699	78,604	2018/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	2,051	230,667	2023/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	1,125	1,116	125,558	2019/04/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,529	5,207	585,388	2026/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,412	271,168	2021/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,300	4,286	481,834	2018/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,014	226,454	2023/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	3,106	349,187	2046/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,507	2,486	279,511	2019/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	4,000	3,992	448,888	2018/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,657	298,765	2021/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,430	273,208	2023/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,100	2,081	233,969	2019/06/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,000	993	111,738	2018/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,429	273,121	2021/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,868	322,504	2023/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,466	277,303	2019/07/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,600	5,203	584,941	2026/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	2,987	335,805	2046/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,500	2,463	276,997	2019/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,200	2,188	245,981	2018/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,589	403,571	2021/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	1,770	1,761	198,026	2018/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,591	403,733	2021/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,634	296,166	2023/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,291	257,558	2023/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	2,600	2,569	288,807	2019/09/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	3,000	2,982	335,243	2018/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,389	268,652	2023/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	2,946	331,294	2021/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.0000	2,147	2,126	239,072	2019/10/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,326	2,310	259,781	2018/10/31
通貨小計	銘 柄 数 額	237銘柄			590,540	599,940	67,445,294	
カナダ		Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	325	389	32,602	2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	386	623	52,150	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,419	118,747	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,722	144,165	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,192	1,768	147,961	2037/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	969	1,020	85,417	2018/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,524	1,639	137,169	2019/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,413	1,913	160,140	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,476	1,612	134,893	2020/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	1,053	88,138	2021/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,351	1,471	123,152	2022/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,491	1,929	161,493	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,276	106,794	2023/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,265	1,274	106,657	2018/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,021	1,031	86,307	2018/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,524	127,547	2024/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	853	873	73,071	2019/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,627	1,671	139,894	2019/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	847	972	81,409	2048/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,232	103,104	2025/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	829	847	70,905	2020/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,772	1,784	149,363	2018/02/01

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	期末			償還年月日
					評価額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	931	927	77,617	2020/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,029	1,027	85,973	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,128	1,124	94,083	2017/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,237	1,228	102,812	2021/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,284	1,276	106,821	2018/05/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	980	970	81,231	2021/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,344	1,340	112,143	2018/08/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	390	366	30,662	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	797	66,721	2018/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	340	330	27,671	2022/03/01	
通貨小計	銘柄数	32銘柄		34,684	38,441	3,216,825		
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.2500	2,455	2,642	222,320	2019/03/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,795	235,185	2021/05/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,209	2,391	201,240	2020/04/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,032	2,406	202,494	2022/07/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,063	2,151	181,056	2018/01/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,450	206,174	2023/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,066	258,016	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,173	2,209	185,929	2024/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,314	1,362	114,641	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,398	2,516	211,714	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	958	1,127	94,871	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,197	1,230	103,500	2018/10/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,848	3,224	271,333	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,511	1,547	130,191	2019/10/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	863	914	76,950	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	557	516	43,458	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,495	1,478	124,420	2020/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	412	400	33,659	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,592	1,589	133,719	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	678	640	53,877	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	682	601	50,611	2047/03/21	
通貨小計	銘柄数	21銘柄		34,514	37,263	3,135,370		
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	4.0000	491	515	40,729	2018/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.2500	696	740	58,497	2020/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	442	485	38,360	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	466	36,864	2022/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.5000	599	617	48,736	2019/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	503	531	41,946	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	359	366	28,948	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	495	507	40,106	2021/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	402	31,745	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	504	500	39,509	2018/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	421	438	34,619	2023/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	238	257	20,354	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	125	128	10,172	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	270	272	21,503	2019/10/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	224	225	17,804	2025/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	224	228	18,025	2020/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	168	169	13,346	2046/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	250	246	19,449	2026/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	190	186	14,698	2021/10/01	
通貨小計	銘柄数	19銘柄		7,037	7,286	575,419		
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,380	2,514	353,215	2020/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	2,121	2,254	316,624	2025/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,572	361,383	2021/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,182	1,445	202,997	2065/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	945	955	134,181	2026/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	60	58	8,280	2022/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	400	358	50,352	2047/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,470	206,532	2021/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,414	198,705	2028/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,840	2,455	344,845	2032/06/07	

外国債券インデックスマザーファンド

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	期末			償還年月日
					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	5.0000	1,472	1,915	269,094		2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,032	2,790	391,988		2026/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,457	2,179	306,177		2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,724	1,974	277,386		2020/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,856	401,266		2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,666	2,512	352,951		2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,574	221,188		2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,604	1,704	239,378		2018/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,666	2,510	352,647		2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,500	2,073	291,257		2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,373	2,149	301,967		2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,573	1,729	242,971		2019/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,246	1,758	247,066		2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,232	1,445	203,087		2022/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,870	2,611	366,831		2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,428	1,568	220,373		2019/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,244	2,061	289,583		2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,795	2,020	283,792		2020/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,252	316,420		2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,633	1,875	263,478		2021/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,182	1,752	246,196		2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,364	332,105		2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,156	2,706	380,144		2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	2,854	2,908	408,489		2018/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,942	2,110	296,422		2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,621	2,536	356,236		2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,161	2,250	316,039		2019/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,842	2,068	290,524		2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,324	3,056	429,352		2045/01/22
通貨小計	銘柄数 総金額	39銘柄		62,812	78,823	11,071,541		
スイス				千スイス・フラン	千スイス・フラン			
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	404	517	57,538		2023/02/11
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	497	728	80,987		2028/04/08
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	605	632	70,223		2018/01/08
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	517	567	63,048		2019/05/12
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	407	452	50,280		2020/07/06
	SWISS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	362	405	45,102		2021/04/28
通貨小計	銘柄数 総金額	6銘柄						
デンマーク				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ			
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	7.0000	1,864	2,885	46,427		2024/11/10
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	5,291	5,527	88,940		2017/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	11,512	20,161	324,391		2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	8,601	9,762	157,081		2019/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	7,650	8,894	143,117		2021/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,846	6,445	103,712		2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	7,863	8,841	142,258		2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,164	3,214	51,721		2018/11/15
通貨小計	銘柄数 総金額	8銘柄		51,791	65,733	1,057,649		
ノルウェー				千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ			
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	6,075	6,635	87,459		2019/05/22
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,698	7,476	98,540		2021/05/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,824	5,022	66,196		2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,535	59,780		2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,452	45,503		2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,140	3,114	41,043		2026/02/19
通貨小計	銘柄数 総金額	6銘柄		28,227	30,237	398,524		
スウェーデン				千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ			
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	8,095	9,879	121,018		2020/12/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	8,385	9,345	114,485		2019/03/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	5,826	71,369		2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,165	9,832	120,453		2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,734	94,752		2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,495	6,524	79,921		2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	6,080	6,378	78,140		2026/11/12
通貨小計	銘柄数 総金額	7銘柄		47,400	55,521	680,141		

区分	銘柄	種類	年利	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	債券	5.0000	15,647	14,937	81,411	2019/12/11
	Mexican Bonos	国債	債券	5.7500	7,590	6,799	37,055	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債	債券	8.0000	8,233	8,610	46,926	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債	債券	10.0000	21,119	24,629	134,232	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債	債券	7.5000	8,568	8,607	46,912	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債	債券	7.7500	13,756	13,993	76,263	2017/12/14
	Mexican Bonos	国債	債券	10.0000	6,874	8,540	46,543	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債	債券	8.5000	8,844	9,558	52,094	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債	債券	8.5000	22,092	22,897	124,793	2018/12/13
	Mexican Bonos	国債	債券	8.5000	9,694	10,562	57,565	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債	債券	8.0000	12,728	13,231	72,112	2020/06/11
	Mexican Bonos	国債	債券	6.5000	21,626	21,194	115,508	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債	債券	7.7500	13,015	13,231	72,109	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債	債券	6.5000	11,399	11,089	60,436	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債	債券	7.7500	14,654	14,801	80,666	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債	債券	4.7500	16,633	16,247	88,549	2018/06/14
	Mexican Bonos	国債	債券	7.7500	6,944	7,045	38,396	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	17銘柄			219,416	225,977	1,231,577	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	4.2400	1,210	1,213	30,560	2018/02/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	5.7340	647	672	16,930	2019/07/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.5020	573	517	13,029	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	5.2480	738	770	19,406	2028/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	4.3780	1,603	1,611	40,573	2019/11/29
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	4.4980	1,178	1,140	28,724	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	4.1600	1,916	1,912	48,150	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	4.3920	1,514	1,463	36,860	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	4.2320	420	395	9,953	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.5800	1,595	1,586	39,949	2018/09/28
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.4180	875	829	20,888	2022/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.8920	731	678	17,073	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	4.1270	618	560	14,106	2032/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.3140	599	597	15,052	2017/10/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.4920	1,044	1,017	25,621	2020/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.2600	533	528	13,307	2018/03/01
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.4800	1,001	938	23,638	2023/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.8440	477	424	10,700	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.7330	586	530	13,354	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.8890	656	645	16,258	2020/07/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	4.9350	600	587	14,790	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	4.1810	1,057	1,028	25,898	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	4.0480	857	850	21,422	2021/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.6540	648	640	16,115	2019/10/31
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.9550	737	702	17,691	2025/09/15	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.6590	700	687	17,315	2020/10/15	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.7950	1,161	1,115	28,079	2022/09/30	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	4.2540	620	573	14,429	2035/05/31	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.7590	768	765	19,278	2019/03/15	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.8000	702	682	17,174	2023/08/17	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	4.7360	450	434	10,948	2046/03/15	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.9000	50	47	1,202	2026/11/30	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債	債券	3.6200	352	344	8,676	2021/11/30	
通貨小計	銘柄数	33銘柄			27,216	26,495	667,167	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債	債券	8.0000	4,178	4,179	33,849	2018/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債	債券	7.2500	5,768	5,614	45,480	2020/01/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債	債券	10.5000	15,434	16,954	137,329	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債	債券	6.2500	7,612	5,398	43,731	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債	債券	6.7500	6,122	5,756	46,624	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債	債券	6.5000	8,904	6,265	50,752	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債	債券	7.0000	8,999	7,329	59,365	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債	債券	7.7500	4,639	4,429	35,877	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債	債券	8.7500	10,852	9,809	79,460	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債	債券	8.5000	7,321	6,550	53,055	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債	債券	8.0000	7,862	7,048	57,091	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債	債券	8.7500	6,044	5,475	44,351	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債	債券	8.2500	5,943	5,346	43,302	2032/03/31

外国債券インデックスマザーファンド

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券 国債証券	8.8750% 9.0000%	千南アフリカ・ランド 3,166 1,579	千南アフリカ・ランド 2,957 1,472	千円 23,954 11,930	2035/02/28 2040/01/31
通貨小計	銘柄数 15銘柄			104,423	94,567	766,157	
ポーランド	Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond	国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券	5.7500 5.5000 1.5000 2.5000 2.0000 — 1.7500 5.7500 5.2500 4.0000 3.7500 2.5000 3.2500 3.2500	千ポーランド・ズロチ 2,309 1,912 2,078 3,377 2,127 1,668 3,051 627 2,256 884 1,720 2,099 1,840 2,591	千ポーランド・ズロチ 2,624 2,085 2,016 3,073 2,056 1,609 2,905 748 2,478 998 1,767 2,681 1,893 2,538	千円 70,841 56,275 54,428 82,956 55,512 43,439 78,429 20,198 66,885 26,941 47,703 72,368 51,111 68,520	2022/09/23 2019/10/25 2020/04/25 2026/07/25 2021/04/25 2018/10/25 2021/07/25 2029/04/25 2020/10/25 2021/10/25 2023/10/25 2018/04/25 2018/07/25 2019/07/25 2025/07/25
通貨小計	銘柄数 15銘柄			31,114	31,602	852,954	
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY IRISH TREASURY IRISH TREASURY IRISH TREASURY IRISH TREASURY IRISH TREASURY IRISH TREASURY IRISH TREASURY IRISH TREASURY IRISH TREASURY IRISH TREASURY IRISH TREASURY IRISH TREASURY	国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券	4.5000 4.4000 5.9000 5.4000 5.0000 3.9000 3.4000 2.4000 0.8000 2.0000 1.0000 4.5000	千ユーロ 759 684 570 1,131 765 504 607 761 516 531 473 1,035	千ユーロ 831 769 674 1,561 923 620 734 874 539 562 479 1,205	千円 99,506 92,122 80,755 186,887 110,512 74,279 87,889 104,695 64,526 67,334 57,348 144,243	2018/10/18 2019/06/18 2019/10/18 2025/03/13 2020/10/18 2023/03/20 2024/03/18 2030/05/15 2022/03/15 2045/02/18 2026/05/15 2020/04/18
国小計	銘柄数 12銘柄			8,336	9,775	1,170,103	
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券 国債証券	7.5000 5.5000 4.0000 3.7500 4.0000 4.0000 3.5000 3.7500 3.2500 2.2500 2.5000 1.2500 1.7500 1.2500 2.7500 2.0000 0.2500 — 0.2500 0.5000 —	千ユーロ 548 1,239 1,355 791 1,544 1,347 1,146 1,349 1,463 1,438 1,168 1,477 1,385 924 1,004 1,514 1,374 1,323 1,291 948 400	千ユーロ 810 1,918 2,168 986 1,663 1,514 1,318 2,224 1,716 1,646 1,487 1,510 1,558 962 1,468 1,736 1,412 1,336 1,291 958 406	千円 97,025 229,702 259,569 118,036 199,097 181,301 157,806 266,240 205,481 197,104 178,061 180,838 186,595 115,270 175,726 207,914 169,115 159,954 154,596 114,682 48,681	2023/01/15 2028/01/15 2037/01/15 2023/01/15 2018/07/15 2019/07/15 2020/07/15 2042/01/15 2021/07/15 2022/07/15 2033/01/15 2018/01/15 2023/07/15 2019/01/15 2047/01/15 2024/07/15 2020/01/15 2018/04/15 2025/07/15 2026/07/15 2022/01/15
国小計	銘柄数 21銘柄			25,028	30,098	3,602,804	
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond Belgium Government Bond Belgium Government Bond Belgium Government Bond Belgium Government Bond Belgium Government Bond Belgium Government Bond	国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券	0.8000 1.0000 1.9000 1.0000 1.6000 2.1500 0.2000	千ユーロ 1,399 924 558 1,283 544 290 150	千ユーロ 1,444 927 630 1,331 557 327 151	千円 172,899 111,056 75,434 159,360 66,725 39,204 18,138	2025/06/22 2031/06/22 2038/06/22 2026/06/22 2047/06/22 2066/06/22 2023/10/22

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 償 還 金 額			償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	評 価 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,611	312,540	2028/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,839	339,911	2035/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	1,377	1,694	202,799	2022/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	966	1,026	122,885	2018/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	1,121	1,242	148,706	2019/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	1,736	2,018	241,660	2020/09/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,474	2,397	287,013	2041/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,768	211,672	2021/09/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	801	1,099	131,659	2026/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,659	198,647	2022/09/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	680	977	117,036	2032/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	1,123	1,236	148,064	2019/09/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,543	184,699	2023/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	1,052	1,083	129,742	2018/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	753	1,170	140,111	2045/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,777	212,784	2024/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	597	785	93,976	2034/06/22	
国小計	銘柄数額	24銘柄		25,843	32,303	3,866,730		
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	653	826	98,910	2019/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	685	1,056	126,519	2023/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,225	3,302	395,282	2025/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,623	4,066	486,746	2029/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,507	4,227	506,029	2032/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,709	4,305	515,370	2035/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,075	3,438	411,565	2019/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,564	2,612	312,730	2055/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,230	3,809	456,505	2021/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,424	3,663	438,478	2038/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,697	4,754	569,112	2023/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,931	3,125	374,083	2018/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,567	2,809	336,319	2018/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,484	4,076	487,923	2041/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,263	3,674	439,891	2019/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,380	3,837	459,403	2020/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,017	1,746	209,039	2060/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,981	476,617	2026/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,113	3,466	414,893	2020/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,550	4,158	497,726	2021/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,480	4,077	488,057	2022/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,099	3,735	447,199	2027/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	3,063	366,724	2022/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,114	2,167	259,473	2018/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,088	2,917	349,277	2045/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,712	444,401	2023/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,920	1,983	237,463	2018/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,086	3,549	424,891	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,764	1,836	219,776	2019/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,787	3,332	398,856	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,799	3,110	372,293	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,322	2,394	286,576	2019/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,792	2,803	335,612	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,070	3,117	373,127	2020/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,335	1,346	161,223	2018/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,101	2,181	261,151	2025/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,193	2,244	268,718	2020/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,020	2,145	256,831	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,592	1,614	193,295	2019/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,737	2,700	323,196	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	879	871	104,333	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	257	255	30,571	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,170	2,194	262,660	2021/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,000	956	114,455	2026/11/25	
国小計	銘柄数額	44銘柄		104,489	125,253	14,992,864		
ユーロ (ドイツ)	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	774	1,129	135,222	2024/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,067	1,764	211,170	2027/07/04	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 償 還 金 額			償 還 年 月 日
					評 価			
					外 貨 建 金 額	千 円	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,157	258,272	2028/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,426	170,712	2028/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,663	199,076	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,443	292,507	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	3,009	360,213	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,071	3,364	402,736	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	2,120	253,870	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,798	1,894	226,743	2018/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,211	2,390	286,093	2018/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,399	2,605	311,896	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	2,682	2,938	351,793	2019/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,481	2,757	330,079	2019/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,075	2,331	279,106	2020/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,928	2,183	261,380	2020/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,374	2,146	256,990	2042/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,444	1,603	191,955	2020/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,631	315,047	2021/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,968	235,598	2021/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,602	191,824	2021/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,707	1,921	229,954	2022/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,489	297,962	2022/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,728	2,429	290,806	2044/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,821	218,045	2022/09/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,568	187,757	2023/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	2,025	242,474	2023/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,839	220,200	2023/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,778	212,917	2024/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,709	2,431	291,001	2046/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,789	214,251	2024/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,673	200,316	2024/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,394	2,497	298,989	2025/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,034	2,200	263,424	2025/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,168	2,238	267,941	2026/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,700	1,663	199,086	2026/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	733	739	88,501	2017/12/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	747	754	90,354	2018/03/16	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,500	1,518	181,740	2018/06/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	700	709	84,957	2018/09/14	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,209	144,771	2018/02/23	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,392	1,412	169,023	2018/04/13	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,209	1,249	149,578	2018/10/12	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,438	1,495	178,962	2019/02/22	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,113	1,146	137,245	2019/04/12	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,151	1,183	141,679	2019/10/11	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,731	1,770	211,972	2020/04/17	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,448	1,496	179,177	2020/10/16	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,578	1,615	193,319	2021/04/09	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,200	1,227	146,873	2021/10/08	
国小計	銘柄数 金額	50銘柄		78,396	94,031	11,255,580		
ユーロ (スペイン)				千ユーロ	千ユーロ			
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,832	2,677	320,460	2029/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,735	1,746	209,097	2017/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,745	1,779	212,989	2025/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,552	1,556	186,368	2030/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	260	261	31,277	2018/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,792	1,898	227,241	2025/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1500	1,250	1,288	154,273	2020/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,802	215,802	2026/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,172	1,175	140,721	2019/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,067	1,077	129,032	2021/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	852	879	105,299	2046/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	400	430	51,527	2066/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,230	1,204	144,178	2026/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	2,965	355,000	2032/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,654	2,148	257,145	2037/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,428	2,036	243,820	2040/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1000	2,206	2,357	282,135	2018/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	2,111	252,774	2024/01/31	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未 償 還 金 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6000	2,382	2,659	318,348	2019/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3000	1,775	1,985	237,613	2019/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,173	1,630	195,129	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,101	2,365	283,127	2020/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	1,789	2,264	271,009	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	1,681	1,973	236,172	2020/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,515	3,066	367,061	2021/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,265	1,761	210,907	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,499	299,173	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,000	2,108	252,387	2018/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,158	2,747	328,826	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,601	1,961	234,766	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,270	1,732	207,323	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,564	1,677	200,796	2018/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,049	1,558	186,502	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,836	1,951	233,588	2019/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,335	279,565	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,330	278,981	2024/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	1,968	235,587	2020/01/31
国小計	銘柄数額	37銘柄		59,673	69,975	8,376,016	
ユーロ (イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,658	198,464	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	510	755	90,433	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,431	410,709	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,925	230,496	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,376	1,388	166,245	2018/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0500	1,445	1,470	176,066	2019/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,129	1,188	142,320	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,229	1,246	149,192	2022/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,654	198,097	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,465	1,345	161,084	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,258	1,261	150,968	2018/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,511	1,519	181,890	2020/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,591	1,611	192,943	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,529	183,028	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3000	371	371	44,503	2018/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	774	775	92,781	2020/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,140	1,074	128,617	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,259	1,234	147,777	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,286	1,254	150,168	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	812	807	96,622	2019/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,674	1,648	197,380	2021/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	924	878	105,198	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,218	1,141	136,610	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	700	664	79,595	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	358	348	41,666	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	448	390	46,755	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	358	354	42,401	2019/10/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,654	3,559	426,023	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,127	494,080	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,455	2,089	250,133	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,074	2,250	269,409	2019/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,921	2,161	258,787	2020/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,098	2,829	338,657	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,390	2,878	344,515	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	3,098	370,873	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,480	2,610	312,482	2018/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,734	2,355	281,901	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,101	2,559	306,384	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,187	2,346	280,831	2018/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,708	2,961	354,516	2019/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,531	2,796	334,726	2019/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,654	317,706	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,893	2,561	306,665	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.2500	2,560	2,869	343,433	2020/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,214	2,493	298,444	2020/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,527	302,580	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,415	289,106	2021/03/01

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	千 円	邦 貨 換 算 金 額	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500%	千ユーロ 2,281	千ユーロ 2,692	千円 322,321		2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000%	2,012	2,418	289,540		2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.5000%	1,657	2,059	246,567		2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.5000%	1,910	2,376	284,457		2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.5000%	1,295	1,338	160,241		2017/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500%	1,810	2,302	275,639		2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000%	1,594	1,905	228,092		2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.5000%	1,770	1,861	222,820		2018/06/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500%	1,363	1,805	216,175		2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000%	2,194	2,638	315,836		2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.5000%	2,111	2,248	269,111		2018/12/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.7500%	1,729	1,950	233,421		2021/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	2.5000%	1,100	1,156	138,393		2019/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.7500%	1,901	2,191	262,266		2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.5000%	1,938	2,219	265,627		2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	2.1500%	1,593	1,688	202,077		2021/12/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	1.5000%	1,246	1,282	153,495		2019/08/01
国 小 計	銘 柄 数 額 金 額	64銘柄		105,758	121,214	14,509,366		
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.3750%	千ユーロ 432	千ユーロ 445	53,371		2020/09/15
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.7500%	414	411	49,285		2031/04/15
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.8750%	279	292	35,065		2025/09/15
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.5000%	411	414	49,639		2026/04/15
	Finland Government Bond	国 債 証 券	—	200	199	23,929		2023/09/15
	Finland Government Bond	国 債 証 券	4.3750%	416	470	56,341		2019/07/04
	Finland Government Bond	国 債 証 券	4.0000%	667	882	105,596		2025/07/04
	Finland Government Bond	国 債 証 券	3.3750%	632	716	85,742		2020/04/15
	Finland Government Bond	国 債 証 券	3.5000%	459	537	64,392		2021/04/15
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.7500%	389	484	58,009		2028/07/04
	Finland Government Bond	国 債 証 券	1.6250%	612	677	81,098		2022/09/15
	Finland Government Bond	国 債 証 券	1.5000%	446	491	58,786		2023/04/15
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.6250%	407	558	66,799		2042/07/04
	Finland Government Bond	国 債 証 券	1.1250%	425	438	52,537		2018/09/15
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.0000%	529	603	72,291		2024/04/15
国 小 計	銘 柄 数 額 金 額	15銘柄		6,718	7,626	912,887		
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.2500%	千ユーロ 527	千ユーロ 539	64,592		2019/10/18
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.2000%	873	939	112,451		2025/10/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.7500%	576	588	70,442		2026/10/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.5000%	234	245	29,375		2047/02/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	6.2500%	985	1,575	188,607		2027/07/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.6500%	1,066	1,131	135,386		2018/01/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.9000%	1,248	1,446	173,136		2020/07/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.5000%	1,337	1,583	189,521		2021/09/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.1500%	1,073	1,692	202,604		2037/03/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.3500%	989	1,102	131,978		2019/03/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.8500%	675	953	114,130		2026/03/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.6500%	797	963	115,327		2022/04/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.4000%	872	1,056	126,485		2022/11/22
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.8000%	318	574	68,743		2062/01/26
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.9500%	738	787	94,228		2019/06/18
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.1500%	623	907	108,628		2044/06/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.7500%	959	1,076	128,848		2023/10/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	2.4000%	501	620	74,222		2034/05/23
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.1500%	426	440	52,781		2018/10/19
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.6500%	932	1,039	124,444		2024/10/21
国 小 計	銘 柄 数 額 金 額	20銘柄		15,749	19,264	2,305,937		
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	287銘柄		429,990	509,542	60,992,290		
合 計	銘 柄 数 額 金 額	742銘柄				152,458,096		

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年11月30日現在

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

- * 期首における元本額は57,305,049,313円、当期中における追加設定元本額は5,269,599,218円、同解約元本額は3,568,516,951円です。
 * 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスV A 1,426,188,983円、ダイワ国内重視バランスファンド3 0 V A (一般投資家私募) 47,463,120円、ダイワ国内重視バランスファンド5 0 V A (一般投資家私募) 340,370,920円、ダイワ国際分散バランスファンド3 0 V A (一般投資家私募) 85,931,327円、ダイワ国際分散バランスファンド5 0 V A (一般投資家私募) 1,134,382,139円、ダイワファンドラップ・外国債券インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし) 45,058,356円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジなし) 79,097,081円、D-e 1's 外国債券インデックス850,783円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 17,978円、iFree 外国債券インデックス71,282,917円、iFree 8資産バランス23,335,905円、D Cダイワ外国債券インデックス38,020,240,928円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 588,263,235円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 260,217,655円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 159,536,254円、D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース) 251,573,954円、D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース) 202,071,895円、D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース) 59,946,308円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 12,384,412円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 15,705,795円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 932,613円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A 1,705,288,856円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 194,065,438円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 7,200,012,883円、ダイワ・ワールド・バランスファンド5 0 V A 519,885,779円、ダイワ・ワールド・バランスファンド7 5 V A 335,883,404円、ダイワ・バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家専用) 396,659,545円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券103,331,290円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド7,209,795円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,614,367,146円、ダイワライフスタイル2 5 35,139,131円、ダイワライフスタイル5 0 55,152,766円、ダイワライフスタイル7 5 14,282,989円です。
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は26,265円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月1日 至2016年11月30日

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

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